

# Central Daily Market Report

2017年10月19日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2017年10月19日		2017年10月20日		2017年10月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 8,400		▲ 14,600		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 9,400		▲ 15,700		▲ 21,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通		▲ 100			1,600	▲ 2,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			100	▲ 200		
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当預増減	▲ 9,600		▲ 11,700		▲ 21,400	
当座預金残高	3,708,400		3,696,700		3,675,300	
準備預金残高	3,271,300					
積み終了先	3,252,900				10月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,244,800				積数	
非準備預金先	437,100				1日平均	
					35,700	
					1,300	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,019,500	
準備預金進捗率	実績	98.82%	日数	12.90%		

## ●2017年10月19日の市場動向

### <インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比2兆円減少の326兆6,000億円(当座預金残高見込みは370兆9,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.05~▲0.045%、証券業態より▲0.045~▲0.04%、地銀業態より▲0.05~▲0.035%での調達で始まった。一巡後は徐々にビッドが消え、▲0.06%近辺の出合いが数件見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺の出合いが見られた。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオファーされ、応札額1,630億円(期落ち分2,035億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/20-10/23)は、▲0.115~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/23-10/24)は、▲0.100~▲0.09%程度での出合い。短国及び5年利付国債の発行により、担保確保の業者のビッドニーズが大きく減退したことでレートは▲0.10%近辺に戻り、動意の少ない展開が続くこととなった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られ、個別銘柄では2Y379~380、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~55などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は、3M#716の入札が実施された。WI取引において、▲0.181%から▲0.192%へと買い進まれる展開となり、平均落札利回▲0.1924%、按分落札利回▲0.1861%と、WI取引を反映した強い結果となった。セカンダリーでは、▲0.218~▲0.215%で出合う等、強含みで推移した。この他に、1Y物は▲0.18~▲0.173%での出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は小売、商社業態からまとまった発行が見られ、総額1,100億円程度に達した。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/19	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.065	0.050	▲ 0.042				-	▲ 0.103	0.060	▲ 0.005	21,448.52	85.47	113.00-02	112.67-68
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.028	▲ 0.044				-	▲ 0.111						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.210	▲ 0.130						
6M							▲ 0.172	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.178	▲ 0.160						
									日付	10/12	10/13	10/16	10/17	10/18
									日銀当預残	3,647,200	3,710,300	3,700,200	3,705,800	3,718,000
									準備預金残	3,233,500	3,289,900	3,274,300	3,275,000	3,280,300
									マネタリーベース	4,701,900	4,765,100	4,754,400	4,759,800	4,772,200
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.021%	▲0.043%	▲0.043%	▲0.041%
									コール市場残高	96,741	97,344	91,372	90,061	86,556
									うち無担	76,182	75,987	70,771	68,854	69,414
									うちO/N	49,292	49,757	45,871	43,674	43,884
									うち有担	20,559	21,357	20,601	21,207	17,142

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	716	-	43,700	2017/10/23	2018/1/29	149,638.0	35,427.7	100.0500	▲0.1861%	19.6756%	100.0517	▲0.1924%	8,272.0
5年利付国債	133	0.10%	22,000	2017/10/23	2022/9/20	75,599.0	17,829.00	100.9000	▲0.0820%	88.7951%	100.9000	▲0.0820%	4,161.0

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/10/23	2017/11/6		1,630	1,630				
社債等買入	1,000	2017/10/25			2,347	1,001	0.016		0.155	43.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,412	2017/10/19	2017/10/20		263	263		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/10/19	2017/10/20		142	142		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月20日の予定

*黒田日銀総裁、全国信用組合大会にて講演	*米国9月の中古住宅販売
----------------------	--------------

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入