

Central Daily Market Report

2017年10月20日(金)

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20日		2017年10月23日		2017年10月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 8,500		▲ 22,400		2,000	
資金過不足	▲ 9,600		▲ 22,500		1,000	
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			1,600	▲ 2,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					5,000	
国債買入	4,100				9,900	
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
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				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 1,500	400		1,500		
当預増減	▲ 7,100		▲ 21,600		15,900	
当座預金残高	3,701,300		3,679,700		3,695,600	
準備預金残高	3,266,400					
積み終了先	3,263,400				10月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,259,500				積数	14,700
非準備預金先	434,900				1日平均	600
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	99.51%	日数	22.58%		

●2017年10月20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3,000億円減少の326兆3,000億円(当座預金残高見込みは369兆7,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲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、今週の取引を終えた。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。

<レポ市場>

GC T/N(10/23-10/24)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/24-10/25)は、▲0.115~▲0.095%程度での出合い。S/Nは短国・国債買入オペがオファーされたものの、オファーサイドの資金調達ニーズが引き続き見られ、出合い始めは▲0.100%より低い水準でのレートからの引合いとなった。しかし、徐々にオファーが入り始め、レートは上昇傾向となった。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は横ばいで推移した。アウトライト市場は、短国買入オペが5,000億円(前回比▲2,500億円)で実施された。オファー額が予想を下回り、平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.003%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.215%、6M物が▲0.173~▲0.172%、1Y物が▲0.174~▲0.17%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は銀行、ノンバンク業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は650億円程度と閑散。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/10/20	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.099	0.070	0.010	21,457.64	9.12	112.68-69	113.32-33
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.112						
2W			0.000				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.117						
3M			0.380				▲ 0.206	▲ 0.136						
6M							▲ 0.173	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.174	▲ 0.160						
									日付	10/13	10/16	10/17	10/18	10/19
									日銀当預残	3,710,300	3,700,200	3,705,800	3,718,000	3,708,400
									準備預金残	3,289,900	3,274,300	3,275,000	3,280,300	3,271,300
									マネタリーベース	4,765,100	4,754,400	4,759,800	4,772,200	4,763,600
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.043%	▲0.043%	▲0.041%	▲0.042%
									コール市場残高	97,344	91,372	90,061	86,556	93,215
									うち無担	75,987	70,771	68,854	69,414	71,860
									うちO/N	49,757	45,871	43,674	43,884	44,895
									うち有担	21,357	20,601	21,207	17,142	21,355

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国庫短期証券買入	5,000	2017/10/24			14,248	5,003	0.003		0.007	31.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/10/24			10,348	2,805	0.005		0.006	52.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/10/24			12,554	3,000		0.008	0.009	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/24			13,486	4,105	0.008		0.010	39.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	17,749	2017/10/20	2017/10/23		1,319	1,319		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月23日の予定

*8月の景気動向指数改訂状況

◆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お客様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