

# Central Daily Market Report

2017年10月25日(水)

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25日		2017年10月26日		2017年10月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,500		▲ 2,000	
財政	8,800		▲ 4,700		1,000	
資金過不足	8,000		▲ 6,200		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入					8,800	
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000	▲ 200		▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	8,200		▲ 6,200		7,800	
当座預金残高	3,701,300		3,695,100		3,702,900	
準備預金残高	3,266,700					
積み終了先	3,266,000					
超過準備	3,265,000					
非準備預金先	434,600					
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	99.75%	日数	32.26%		

## ●2017年10月25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4,000億円増加の326兆8,000億円(当座預金残高見込みは369兆8,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.05%、地銀、証券業態より▲0.045~▲0.035%での調達で始まった。一巡後は調達レートが低下し、▲0.06%近辺の散発的な出会いが見られる中、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%近辺の出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(10/26-10/27)は、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。S/N(10/27-10/30)は、▲0.105~▲0.095%程度での出会いとなった。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2Y379~381、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~56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、動意なく閑散で、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、償還総額400億円程度に対して、発行総額は700億円程度と若干の発行超となった。全般的に小型案件が中心の落ち着いたマーケットであった。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

2017/10/25	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.098	0.065	0.000	21,707.62	▲ 97.55	113.94-96	113.89-90
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.113						
2W							-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.193	▲ 0.134						
6M							▲ 0.174	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.179	▲ 0.162						
									日付	10/18	10/19	10/20	10/23	10/24
									日銀当預残	3,718,000	3,708,400	3,701,300	3,681,700	3,693,100
									準備預金残	3,280,300	3,271,300	3,266,400	3,252,800	3,262,800
									マネタリーベース	4,772,200	4,763,600	4,757,600	4,738,000	4,750,400
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.042%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.041%
									コール市場残高	86,556	93,215	95,564	89,698	91,383
									うち無担	69,414	71,860	72,638	68,094	69,620
									うちO/N	43,884	44,895	44,993	40,279	41,105
									うち有担	17,142	21,355	22,926	21,604	21,763

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/11/2	2018/5/2	170,270.0	10,500.15		0.0000%	6.2104%		0.0000%	

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/10/27			9,961	2,805	0.003		0.004	19.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/10/27			12,376	3,004	0.002		0.003	26.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/27			4,260	2,005	0.000		0.002	22.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/27			3,926	1,003	0.002		0.003	58.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24,834	2017/10/25	2017/10/26		300	300		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2017/10/25	2017/10/26		90	90		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月26日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(717回)入札 (3ヶ月、44,000億円、10/30発行)
		*2年利付国債入札 (22,000億円、11/15発行)

◆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