

# Central Daily Market Report

2017年10月30日(月)

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30日		2017年10月31日		2017年11月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 700		0	
財政	▲ 12,500		600		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 12,500		▲ 100		▲ 3,000	
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	1,300	▲ 1,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入			7,500		6,500	
CP等買入		▲ 500	3,000	▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 13,400		12,300		3,500	
当座預金残高	3,694,100		3,706,400		3,709,900	
準備預金残高	3,267,900					
積み終了先	3,267,600					
超過準備	3,267,100					
非準備預金先	426,200					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,019,000	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	48.39%		

## ●2017年10月30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、前営業日比5,000億円減少の326兆7,000億円(当座預金残高見込みは369兆4,000億円)。本日の無担O/N物は地銀業態より▲0.035~▲0.03%、証券業態より▲0.035%、都銀、信託業態より▲0.05%での調達で始まった。一巡後は調達レートが低下し、▲0.06~▲0.05%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、目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(10/31-11/1)は▲0.180~▲0.140%程度での出会い。S/N(11/1-11/2)は▲0.110~▲0.105%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は横ばい圏で推移した。発行市場は、鉄鋼、ノンバンク等の業態でまとまった額の調達が見られ、償還総額600億円程度に対し、発行総額は2,000億円程度と発行超となった。引き続き買いニーズは強く、発行レートは低位で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2017/10/30	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	▲ 0.040				-	▲ 0.100	0.065	0.000	22,011.67	3.22	113.71-73	113.71-72
T/N							-	▲ 0.152						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.040	0.022	▲ 0.031				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.116						
3M			0.050				▲ 0.200	▲ 0.133						
6M							▲ 0.175	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.181	▲ 0.162						
									日付	10/23	10/24	10/25	10/26	10/27
									日銀当預残	3,681,700	3,693,100	3,701,300	3,696,000	3,707,500
									準備預金残	3,252,800	3,262,800	3,266,700	3,263,600	3,268,100
									マネタリーベース	4,738,000	4,750,400	4,759,400	4,755,800	4,769,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.041%	▲ 0.041%	▲ 0.041%	▲ 0.039%
									コール市場残高	89,698	91,383	94,304	95,363	96,163
									うち無担	68,094	69,620	71,621	73,028	73,459
									うちO/N	40,279	41,105	42,726	44,033	43,144
									うち有担	21,604	21,763	22,683	22,335	22,704

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/11/1			1,905	702	0.001		0.004	58.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/11/1			8,150	2,804	▲0.002		▲0.001	96.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/1			15,237	3,001	0.000		0.000	95.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,132	2017/10/30	2017/10/31		166	166		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,278	2017/10/30	2017/10/31		30	30		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月31日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*FOMC(1日目)
*黒田日銀総裁、定例会見 *経済・物価情勢の展望	*米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*9月の完全失業率(市場予想：2.8%) *9月の有効求人倍率(市場予想：1.53倍)	*米国10月のCB消費者信頼感指数
*9月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+0.7%)	*米国10月のシカゴPM景況感指数
*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.5%)	*ユーロ圏7-9月期のGDP1次速報
*9月の住宅着工統計	*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値

◆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