

Central Daily Market Report

2017年10月13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13日		2017年10月16日		2017年10月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		600			0
財政	63,900		▲ 18,600		▲ 4,000	
資金過不足	63,700		▲ 18,000		▲ 4,000	
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			1,400	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入			7,800			
CP等買入		▲ 600		▲ 300	3,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	700		600			
国債補充供給	▲ 700		700			
当預増減	63,100		▲ 10,100		6,500	
当座預金残高	3,710,300		3,700,200		3,706,700	
準備預金残高	3,289,900					
積み終了先	3,289,900					
超過準備	3,289,800					
非準備預金先	420,400					
10月16日以降の残り所要積立額					3,019,500	
積数					1日平均	97.400
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		0.00%		日数	0.00%

●2017年10月13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5兆5,000億円増加の329兆3,000億円(当座預金残高見込みは371兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.03~▲0.01%、証券業態から▲0.04~▲0.015%近辺、都銀・信託業態から▲0.045~▲0.02%近辺の調達希望。実質的な積み最終日にあたるため、参加者の調達意欲は昨日に引き続き強く、朝方は▲0.02~▲0.01%の出合いが中心となった。一巡後はやや取り下がり、▲0.06~▲0.02%のレンジの出合いで推移した。ターム物は、新しい積み期間に入る16日スタートのショートタームで出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/16-10/17)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。S/N(10/17-10/18)は、▲0.115~▲0.105%程度での出合い。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5Y130~133、10Y336~348、20Y162、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は横ばいで推移した。アウトライト市場は、短国買入オペが7,500億円(前回比▲2,500億円)で実施された。応札倍率は3倍台と高かったものの、マーケットで全体的に底堅い動きをしていたためか、売り急ぐような動きはなく、結果は平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差▲0.001%と落ち着いた結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.182%、6M物が▲0.175~▲0.17%、1Y物が▲0.17~▲0.166%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。CP発行市場は、償還が少額であったこともあり、発行総額は650億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/10/13	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.097	0.060	0.000	21,155.18	200.46	112.23-25	112.00-01
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.035	0.022	▲ 0.015				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.183	▲ 0.122						
6M							▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.166	▲ 0.153						
									日付	10/5	10/6	10/10	10/11	10/12
									日銀当預残	3,633,100	3,639,700	3,614,300	3,637,200	3,647,200
									準備預金残	3,208,600	3,219,600	3,211,900	3,233,000	3,233,500
									マネタリーベース	4,688,300	4,695,500	4,669,300	4,691,100	4,701,900
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.028%	▲0.029%	▲0.024%	▲0.021%
									コール市場残高	98,318	104,896	93,907	96,044	96,741
									うち無担	77,439	82,931	73,555	74,879	76,182
									うちO/N	50,099	55,221	46,775	48,369	49,292
									うち有担	20,879	21,965	20,352	21,165	20,559

●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)
流動性供給	247	-	5,500	2017/10/17		19,909.0	5,466.00		0.0020%	49.7614%		0.0010%	

●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	7,500	2017/10/17			25,335	7,503	▲0.001		0.001	82.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,000	2017/10/13	2017/10/16		628	628		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月16日の予定

*8月の石油等消費動態統計

◆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