

# Central Daily Market Report

2017年10月23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23日		2017年10月24日		2017年10月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 700		▲ 1,000	
財政	▲ 20,300		▲ 3,400		2,000	
資金過不足	▲ 20,400		▲ 4,100		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			10,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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			1,000	
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	1,500		100		
当預増減	▲ 19,600		10,800		2,000	
当座預金残高	3,681,700		3,692,500		3,694,500	
準備預金残高	3,252,800					
積み終了先	3,250,100				10月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,250,000				積数	
非準備預金先	428,900				1日平均	
					500	
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	99.61%	日数	25.81%		

## ●2017年10月23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1兆1,000億円減少の325兆2,000億円(当座預金残高見込みは368兆円)。本日の無担O/N物は信託業態より▲0.055%、証券業態より▲0.045~▲0.04%、地銀業態より▲0.045~▲0.035%での調達で始まった。一巡後はビッドが薄くなり、▲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。

### <レポ市場>

GCT/N(10/24-10/25)は、▲0.095~▲0.09%程度での出合い。S/N(10/25-10/26)は、▲0.105~▲0.095%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、動意なく閑散な中、6M物が▲0.175%での出合いが見られた。

### <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800億円弱に対して、発行総額は1,800億円弱と発行超であった。一部の鉄鋼・ノンバンク業態で大型案件は見られたものの、五・十日発行としては比較的閑散なマーケットとなった。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

2017/10/23	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	▲ 0.075	0.010	▲ 0.042				-	▲ 0.097	0.065	▲ 0.005	21,696.65	239.01	114.04-06	113.77-79
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.400	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.114						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.114						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.208	▲ 0.135						
6M							▲ 0.174	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.176	▲ 0.161						
									日付	10/16	10/17	10/18	10/19	10/20
									日銀当預残	3,700,200	3,705,800	3,718,000	3,708,400	3,701,300
									準備預金残	3,274,300	3,275,000	3,280,300	3,271,300	3,266,400
									マネタリーベース	4,754,400	4,759,800	4,772,200	4,763,600	4,757,600
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.043%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.041%
									コール市場残高	91,372	90,061	86,556	93,215	95,564
									うち無担	70,771	68,854	69,414	71,860	72,638
									うちO/N	45,871	43,674	43,884	44,895	44,993
									うち有担	20,601	21,207	17,142	21,355	22,926

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,056	2017/10/23	2017/10/24		55	55		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,970	2017/10/23	2017/10/24		10	10		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年10月24日の予定

*流動性供給入札 (4,000億円、10/26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。

◆本資料は何ら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