

Central Daily Market Report

2017年10月27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27日		2017年10月30日		2017年10月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		0		800	
財政	4,600		▲ 12,400		1,300	
資金過不足	2,600		▲ 12,400		2,100	
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	9,100				7,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 500	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				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給						
当預増減	11,500		▲ 13,100		15,000	
当座預金残高	3,707,500		3,694,400		3,709,400	
準備預金残高	3,268,100					
積み終了先	3,267,200				10月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,267,200				積数 3,900	
非準備預金先	439,400				1日平均 200	
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		99.87%		日数 45.16%	

●2017年10月27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8,000億円増加の327兆2,000億円(当座預金残高見込みは370兆7,000億円)。本日の無担O/N物は地銀業態より▲0.045~▲0.03%、証券業態より▲0.035%での調達で始まった。出合いの中心は▲0.035%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06~▲0.04%近辺の散発的な出合いが見られる中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(10/30-10/31)は▲0.105~▲0.095%程度での出合い。S/N(10/31-11/1)は末初にあたり、投資家のオファーが出づらいつ中、業者の買いが入ったことで大幅にレートが低下し、▲0.20%程度での出合いとなった。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、短国買入オペが事前予想通りの2,500億円(前回比▲2500億円)で実施された。平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.001%と売り急ぐ動きは見えず、落ち着いた結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.204~▲0.20%、1Y物が▲0.182~▲0.181%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額7,000億円程度に対して、発行総額は6,000億円強と償還超となった。発行日が月末となったことで幅広い業態からの調達が見られたが、大型の発行案件は限定的であった。発行レートは、一部の銘柄においては低下していたものの、それ以外は概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/10/27	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	▲ 0.039				-	▲ 0.098	0.065	0.000	22,008.45	268.67	114.12-14	114.10-11
T/N							-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.118						
1M			0.000				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.200	▲ 0.134						
6M							▲ 0.173	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.181	▲ 0.162						
									日付	10/20	10/23	10/24	10/25	10/26
									日銀当預残	3,701,300	3,681,700	3,693,100	3,701,300	3,696,000
									準備預金残	3,266,400	3,252,800	3,262,800	3,266,700	3,263,600
									マネタリーベース	4,757,600	4,738,000	4,750,400	4,759,400	4,755,800
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.042%	▲0.041%	▲0.041%	▲0.041%
									コール市場残高	95,564	89,698	91,383	94,304	95,363
									うち無担	72,638	68,094	69,620	71,621	73,028
									うちO/N	44,993	40,279	41,105	42,726	44,033
									うち有担	22,926	21,604	21,763	22,683	22,335

●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	2,500	2017/10/31			8,786	2,503	▲0.001		▲0.001	80.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/10/31			15,471	4,105	0.005		0.006	24.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/10/31			4,767	2,010	0.005		0.006	58.5
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/10/31			4,078	1,005	0.005		0.007	22.0
国債買入(物価連動債)	250	2017/10/31			1,004	251	0.050		▲0.032	66.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/10/27	2017/10/30			7		▲0.500	▲0.500	

●2017年10月30日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、31日まで)	*9月の商業動態統計速報	*米国9月の個人所得・消費支出
------------------------------	--------------	-----------------

◆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