

Central Daily Market Report

2017年11月6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11月6日		2017年11月7日		2017年11月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,300		800		1,000	
財政	▲24,600		2,100		2,000	
資金過不足	▲23,300		2,900		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	1,500	▲1,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入			7,300		6,800	
CP等買入		▲200		▲400		
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						
国債補完供給	▲100	400		100		
当預増減	▲23,600		10,900		9,800	
当座預金残高	3,673,200		3,684,100		3,693,900	
準備預金残高	3,241,100					
積み終了先	3,240,900					
超過準備	3,240,900					
非準備預金先	432,100					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,019,200
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	70.97%		

●2017年11月6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323兆9,000億円(当座預金残高見込みは367兆4,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.050~▲0.045%、地銀業態より▲0.050~▲0.040%での調達で始まった。一巡後は調達レートが低下し、▲0.060%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(11/7-11/8)は▲0.115~▲0.100%程度での出会い。S/N(11/8-11/9)は▲0.155~▲0.140%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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.21%で出合った。また、WI取引では、9日入札の3M物(720回)が▲0.195%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。発行市場は、案件少なく閑散なマーケットであった。発行レート水準は変わらず0%近辺で決着した。

●短期金融市場関連指標

2017/11/6	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	▲0.046				-	▲0.107	0.020	▲0.030	22,548.35	9.23	114.16-18	114.31-32
T/N							-	▲0.110						
S/N							-	-						
1W	▲0.028	▲0.025	▲0.026				-	▲0.129						
2W			0.000				-	▲0.126						
3W			0.000				-	▲0.126						
1M							-	▲0.129						
3M							▲0.205	▲0.138						
6M							▲0.181	▲0.145						
1Y							▲0.189	▲0.166						
									日付	10/27	10/30	10/31	11/1	11/2
									日銀当預残	3,707,500	3,694,100	3,704,100	3,701,200	3,696,800
									準備預金残	3,268,100	3,267,900	3,257,600	3,264,100	3,254,000
									マネタリーベース	4,769,200	4,755,800	4,766,600	4,764,400	4,761,300
									無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.040%	▲0.046%	▲0.044%	▲0.044%
									コール市場残高	96,163	92,084	87,678	92,504	104,814
									うち無担	73,459	69,999	66,827	74,272	86,680
									うちO/N	43,144	40,234	39,667	44,972	56,270
									うち有担	22,704	22,085	20,851	18,232	18,134

●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	2017/11/8			1,366	702	▲0.060		▲0.024	35.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/11/8			10,271	2,802	▲0.015		▲0.014	73.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/8			11,640	3,005	▲0.015		▲0.014	35.4
国債買入(物価連動債)	250	2017/11/8			888	253	0.080		0.037	92.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,512	2017/11/6	2017/11/7		143	143		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月7日の予定

*9月の毎月勤労統計調査速報	*米9月の消費者信用残高	*流動性供給入札(3,000億円、11/9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お客様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