

# Central Daily Market Report

2017年11月8日(水)  
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8日		2017年11月9日		2017年11月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		300		0	
財政	▲ 500		▲ 2,400		▲ 9,000	
資金過不足	700		▲ 2,100		▲ 9,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,800				9,900	
CP等買入		▲ 100		▲ 400	2,000	
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	100		200			
国債補完供給	▲ 100				100	
当預増減	7,400		▲ 2,200		2,900	
当座預金残高	3,691,300		3,689,100		3,692,000	
準備預金残高	3,256,100					
積み終了先	3,255,800				11月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,255,800				積数	
非準備預金先	435,200				1日平均	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,031,300	
準備預金進捗率	実績		99.97%		日数	
					77.42%	

## ●2017年11月8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4,000億円増加の325兆円6,000億円(当座預金残高見込みは369兆2,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.045%程度、地銀業態より▲0.045~▲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%近辺の散發的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(11/9-11/10)は▲0.105~▲0.100%程度での出合い。S/N(11/10-11/13)は▲0.130~▲0.120%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、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は低水準で推移した。アウトライト市場は、6M物(719回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.225%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2376%、按分落札利回▲0.2276%と、強い結果となった。セカンダリーでは、全体的に少額での出合いとなったが、強含みで推移し、▲0.245~▲0.24%で出合った。3M物は▲0.21%、1Y物は▲0.23~▲0.228%での出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は、大型発行案件少なく、900億円程度の償還に対して発行は800億円程度であった。発行レートは引き続き横ばい圏での決着となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/11/8	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	▲ 0.044				-	▲ 0.106	0.020	▲ 0.005	22,913.82	▲ 23.78	113.74-76	113.82-83
T/N	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.011				-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.130						
2W							-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.129						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.220	▲ 0.137						
6M							▲ 0.239	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.165						
									日付	10/31	11/1	11/2	11/6	11/7
									日銀当預残	3,704,100	3,701,200	3,696,800	3,673,200	3,683,900
									準備預金残	3,257,600	3,264,100	3,254,000	3,241,600	3,246,600
									マネタリーベース	4,766,600	4,764,400	4,761,300	4,736,400	4,746,200
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.045%
									コール市場残高	87,678	92,504	104,814	98,807	96,712
									うち無担	66,827	74,272	86,680	76,166	76,650
									うちO/N	39,667	44,972	56,270	45,236	44,140
									うち有担	20,851	18,232	18,134	22,641	20,062

## ●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)
国庫短期証券	719	-	23,000	2017/11/10	2018/5/10	103,460.0	18,736.7	100.1130	▲0.2276%	9.4171%	100.1180	▲0.2376%	4,263.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/11/16	2018/5/16	195,293.0	10,500.01		0.0000%	5.3766%		0.0000%	

## ●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年超3年以下)	2,800	2017/11/10			12,452	2,804	▲0.014		▲0.012	62.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/10			10,653	3,004	▲0.004		▲0.003	51.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/11/10			16,339	4,105	▲0.003		▲0.003	62.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/11/8	2017/11/9		7	7		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	14,759	2017/11/8	2017/11/9		72	72		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年11月9日の予定

*決定会合における主な意見(10月30、31日分)	*米国9月の卸売売上高	*国庫短期証券(720回)入札(3ヶ月、44,000億円、11/13発行)
*9月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.8%)		*30年利付国債入札(8,000億円、11/13発行)
*9月の特定サービス産業動態統計速報		
*9月の国際収支	*10月の景気ウォッチャー調査	

◆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