

Central Daily Market Report

2017年11月9日(木)
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9日		2017年11月10日		2017年11月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		500		2,000	
財政	▲ 2,500		▲ 12,800		▲ 19,000	
資金過不足	▲ 2,200		▲ 12,300		▲ 17,000	
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					1,300	▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,000			
CP等買入		▲ 400	2,000	▲ 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						
E T F 買入	200		100			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 2,300		▲ 400		▲ 17,000	
当座預金残高	3,689,000		3,688,600		3,671,600	
準備預金残高	3,253,600					
積み終了先	3,253,400				11月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,253,400				積数 700	
非準備預金先	435,400				1日平均 100	
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	99.98%	日数	80.65%		

●2017年11月9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2,000億円減少の325兆円4,000億円(当座預金残高見込みは368兆9,000億円)。本日の無担O/N物は信託・証券業態より▲0.050~▲0.045%、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。固定金利方式の共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされ、1,310億円の応札額(期落ち額1,311億円)で未達となった。

<レポ市場>

GCT/N(11/10~11/13)は▲0.120~▲0.100%程度での出会い。S/N(11/13~11/14)は▲0.115~▲0.110%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、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、3M(720回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.29~▲0.27%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.278%、按分落札利回▲0.2549%と、強い結果となった。テールが流れたことにより、セカンダリーでは、▲0.26~▲0.255%の出会いと、小甘く推移した。その他には、6M物が▲0.255~▲0.25%での出会いが見られた。

<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、電機、商社から大型発行案件が見られ、900億円程度の償還に対して、発行は1,800億円程度まで膨らんだ。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

2017/11/9	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.106	0.025	0.005	22,868.71	▲ 45.11	113.90-92	113.51-53
T/N			0.010				-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.005	▲ 0.033				-	▲ 0.131						
2W							-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.130						
1M	0.000	0.010	0.001				-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.260	▲ 0.143						
6M							▲ 0.250	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.212	▲ 0.166						
									日付	11/1	11/2	11/6	11/7	11/8
									日銀当預残	3,701,200	3,696,800	3,673,200	3,683,900	3,691,300
									準備預金残	3,264,100	3,254,000	3,241,600	3,246,600	3,256,100
									マネタリーベース	4,764,400	4,761,300	4,736,400	4,746,200	4,752,400
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.045%	▲0.044%
									コール市場残高	92,504	104,814	98,807	96,712	95,011
									うち無担	74,272	86,680	76,166	76,650	76,033
									うちO/N	44,972	56,270	45,236	44,140	43,793
									うち有担	18,232	18,134	22,641	20,062	18,978

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	720	-	44,300	2017/11/13	2018/2/19	112,426.0	35,881.5	100.0685	▲0.2549%	3.4180%	100.0747	▲0.2780%	8,418.0
30年利付国債	56	0.80%	8,000	2017/11/13	2047/9/20	22,174.0	6,473.00	100.0000	0.8000%	7.3651%	100.2600	0.7890%	1,519.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/11/13	2017/11/27		1,310	1,310				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/11/9	2017/11/10		7	7		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月10日の予定

*9月の第3次産業活動指数	*New York祝日(Veterans Day, observed)	*エネルギー対策借入
*10月のマネーストック	*米国10月の米財政収支	(5,000億円、11/20借入)
	*米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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