

# Central Daily Market Report

2017年11月10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11月10日		2017年11月13日		2017年11月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		1,100		1,000	
財政	▲ 12,800		▲ 20,200		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 12,200		▲ 19,100		▲ 2,000	
<b>金融調節</b>	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					1,000	
国債買入	10,000				7,100	
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 100		
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		100			
国債補充供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 500		▲ 18,900		6,100	
当座預金残高	3,688,500		3,669,600		3,675,700	
準備預金残高	3,254,300					
積み終了先	3,254,100				11月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,254,100				積数	
非準備預金先	434,200				1日平均	
					200	
					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	99.99%	日数	90.32%		

## ●2017年11月10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2,000億円増加の325兆円6,000億円(当座預金残高見込みは368兆9,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.045~▲0.040%、地銀業態より▲0.045~▲0.035%での調達で始まった。積み終盤の週末であることから、一部取り上がる動きが見られていたものの、全体の水準として横ばいとなり大きな変動は見られなかった。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(11/13-11/14)は▲0.100~▲0.09%程度での出合い。S/N(11/14-11/15)は▲0.115~▲0.100%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短国買入オペが1,000億円(前回と同額)で実施された。買入額が1,000億円と少ないため、特定の銘柄が応札されたと思われ、平均落札利回較差+0.035%、按分落札利回較差+0.030%と甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.245~▲0.23%、6M物が▲0.245~▲0.24%で少額出合った。

### <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、電機業態等から大型発行案件が見られ、発行額は700億円程度であった。発行レートは引き続き横ばい圏での決着であった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/11/10	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	0.035	0.010	22,681.42	▲ 187.29	113.35-36	113.55-57
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.230	▲ 0.008				-	▲ 0.127						
2W			▲ 0.027				-	▲ 0.127						
3W							-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.234	▲ 0.145						
6M							▲ 0.244	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.207	▲ 0.166						
									日付	11/2	11/6	11/7	11/8	11/9
									日銀当預残	3,696,800	3,673,200	3,683,900	3,691,300	3,689,000
									準備預金残	3,254,000	3,241,600	3,246,600	3,256,100	3,253,600
									マネタリーベース	4,761,300	4,736,400	4,746,200	4,752,400	4,749,800
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.046%	▲0.045%	▲0.044%	▲0.044%
									コール市場残高	104,814	98,807	96,712	95,011	99,116
									うち無担	86,680	76,166	76,650	76,033	80,225
									うちO/N	56,270	45,236	44,140	43,793	47,965
									うち有担	18,134	22,641	20,062	18,978	18,891

## ●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)
エネルギー対策	-	-	5,000	2017/11/20	2018/11/20	72,689.0	4,999.98		0.0000%	6.8787%		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
国庫短期証券買入	1,000	2017/11/14			5,984	1,000	0.030		0.035	40.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/11/14			13,259	4,107	0.008		0.008	98.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/11/14			5,998	2,011	0.007		0.008	73.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/11/14			3,942	1,004	▲0.007		▲0.005	27.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	82,223	2017/11/10	2017/11/13		102	102		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,611	2017/11/10	2017/11/13		60	60		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年11月13日の予定

\*10月の企業物価指数

◆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