

Central Daily Market Report

2017年11月13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13日		2017年11月14日		2017年11月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		400		1,000	
財政	▲ 20,400		▲ 1,600		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 19,300		▲ 1,200		▲ 2,000	
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			1,000			
国債買入			7,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 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		500			
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	▲ 19,400		7,800		▲ 2,000	
当座預金残高	3,669,100		3,676,900		3,674,900	
準備預金残高	3,243,600					
積み終了先	3,243,500					
超過準備	3,243,500				11月14日以降の残り所要積立額 積数 0	
非準備預金先	425,500				1日平均 0	
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		100.00%		日数 93.55%	

●2017年11月13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1兆9,000億円減少の323兆円7,000億円(当座預金残高見込みは367兆円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.045%、地銀業態より▲0.050~▲0.040%、都銀・信託業態より▲0.055%での調達で始まった。積み最終週ではあるものの取り急ぎ動きは見られず、落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後も水準に大きな変化は見られず、▲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>

GC T/N(11/14-11/15)は、▲0.095~▲0.085%程度、S/N(11/15-11/16)は、▲0.095~▲0.08%程度で出合いが見られた。短国買入オベが減額されていることや、受渡が積みの最終日にかかること等から、前週に比べてやや高めのレートとなった。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た。個別銘柄では5Y127、130、10Y336、341、342、347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、動意なく閑散で、3M物が▲0.233~▲0.232%、6M物が▲0.24%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、五・十日発行にあたり、償還額2,200億円弱に対して2,400億円程度の発行が見られ、やや膨らんだ。ゴム業態、不動産業態等からはまとまったロットの発行が見られた。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2017/11/13	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.101	0.045	0.010	22,380.99	▲ 300.43	113.69-71	113.45-47
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.028	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.120						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.124						
1M			0.050				-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.230	▲ 0.143						
6M							▲ 0.237	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.166						
									日付	11/6	11/7	11/8	11/9	11/10
									日銀当預残	3,673,200	3,683,900	3,691,300	3,689,000	3,688,500
									準備預金残	3,241,600	3,246,600	3,256,100	3,253,600	3,254,300
									マナタリベース	4,736,400	4,746,200	4,752,400	4,749,800	4,748,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.045%	▲ 0.044%	▲ 0.044%	▲ 0.044%
									コール市場残高	98,807	96,712	95,011	99,116	104,094
									うち無担	76,166	76,650	76,033	80,225	85,237
									うちO/N	45,236	44,140	43,793	47,965	53,417
									うち有担	22,641	20,062	18,978	18,891	18,857

●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)	応募率(%)	落札最低額	落札最高利率	案分率	落札平均価格	落札平均利率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	27,057	2017/11/13	2017/11/14		344	344		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月14日の予定

*米国10月の生産者物価指数	*5年利付国債入札(22,000億円、11/16発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/24借入)
*ユーロ圏7-9月期のGDP2次速報		
*英国10月の消費者物価指数		

◆本資料は信頼できるとさ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