

# Central Daily Market Report

2017年11月15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15日		2017年11月16日		2017年11月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 2,800		▲ 25,300		2,000	
資金過不足	▲ 2,500		▲ 26,100		1,000	
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					9,900	
CP等買入		▲ 700		▲ 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	200					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当増減	▲ 2,900		▲ 26,100		10,900	
当座預金残高	3,673,200		3,647,100		3,658,000	
準備預金残高	3,269,900					
積み終了先	3,269,900					
超過準備	3,269,900					
非準備預金先	403,300					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					2,946,200	
準備預金進捗率	実績		0.00%	日数	0.00%	

## ●2017年11月15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326兆円7,000億円(当座預金残高見込みは367兆5,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.050%、地銀業態より▲0.045~▲0.040%、都銀・信託業態より▲0.060~▲0.055%での調達で始まった。積み最終日にあたることから、一巡後に一部調整の範囲で取り上がる動きが見られたものの、全体の水準としては大きな変化は見られなかった。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(11/16-11/17)は、▲0.10~▲0.09%程度、S/N(11/17-11/20)は、▲0.11~▲0.095%程度で出合いが見られた。総じて資金調達サイドが慎重で、小幅にレートを切り下げる展開だった。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5Y126、127、130、131、10Y336、341、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、1Y(721回)の入札が実施された。このところの軟調地合いから、レートの上昇も予想されたが、WI取引において、▲0.20~▲0.19%での出合いが見られるなか、平均落札利回▲0.2145%、按分落札利回▲0.1936%と、強い結果になった。セカンダリーでは、▲0.215~▲0.21%で出合った。その他には、3M物が▲0.215~▲0.19%、6M物が▲0.23%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。CP発行市場は、償還が150億円弱と少額であったこともあり、500億円程度の発行にとどまり、小規模な発行が中心となった。発行レートに変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/11/15	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	▲ 0.060	0.020	▲ 0.045				-	▲ 0.092	0.040	▲ 0.005	22,028.32	▲ 351.69	113.41-43	112.99-00
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.112						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.117						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.212	▲ 0.139						
6M							▲ 0.227	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.213	▲ 0.164						
									日付	11/8	11/9	11/10	11/13	11/14
									日銀当預残	3,691,300	3,689,000	3,688,500	3,669,100	3,676,100
									準備預金残	3,256,100	3,253,600	3,254,300	3,243,600	3,263,900
									マネタリーベース	4,752,400	4,749,800	4,748,600	4,728,200	4,734,800
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.048%	▲0.048%
									コール市場残高	95,011	99,116	104,094	98,335	104,189
									うち無担	76,033	80,225	85,237	75,954	80,949
									うちO/N	43,793	47,965	53,417	45,184	49,959
									うち有担	18,978	18,891	18,857	22,381	23,240

## ●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	721	-	23,000	2017/11/20	2018/11/20	72,751.0	18,643.00	100.1940	▲0.1936%	25.4000%	100.2150	▲0.2145%	4,357.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/11/17			6,194	2,801	▲0.004		0.000	97.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/17			11,130	3,005	▲0.007		▲0.006	83.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/11/17			12,278	4,112	▲0.004		▲0.003	23.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/11/15	2017/11/16		15	15		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/11/15	2017/11/16		44	44		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年11月16日の予定

*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(721回)入札(3ヶ月、44,000億円、11/20発行)	*20年利付国債入札(10,000億円、11/20発行)
*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値		*国有林野借入(739億円、11/27借入)

◆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