

Central Daily Market Report

2017年11月16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16日		2017年11月17日		2017年11月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 800			0
財政	▲ 26,700		▲ 2,000		▲ 28,000	
資金過不足	▲ 27,700		▲ 2,800		▲ 28,000	
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					2,400	▲ 1,400
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		▲ 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			500			
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 27,700		7,600		▲ 27,000	
当座預金残高	3,645,500		3,653,100		3,626,100	
準備預金残高	3,216,400					
積み終了先	2,002,800					
超過準備	860,300					
非準備預金先	429,100					
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	79.97%	日数	3.33%		

●2017年11月16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、前日比4兆6,000億円減の322兆1,000億円(当座預金残高は364兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.055~▲0.045%、地銀業態から▲0.055~▲0.04%、都銀・信託業態より▲0.07~▲0.06%の調達希望で始まった。新しい積み期間の初日ということもあり調達側から取り急ぐ姿は見られなかった。一巡後は▲0.06%前後での調達が見られる中、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/17-11/20)は、▲0.105~▲0.095%程度、S/N(11/20-11/21)は、▲0.105~▲0.09%程度で出合いが見られた。11/20は短国の発行が2本重なったが、調達ニーズは盛り上がり、レートは前日からほぼ横ばい圏での取引だった。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2Y382、5Y126、127、130、131、10Y336、341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(722回)の入札が実施された。今回の入札は海外勢の需要期待から強めの結果になることも予想される中、WI取引において、▲0.23%から▲0.25%まで買い進まれる展開となり、平均落札利回▲0.2382%、按分落札利回▲0.2270%と、WI取引を反映した強い結果になった。セカンダリーでは、▲0.249~▲0.24%で出合い、小高く推移した。その他には、1Y物が▲0.213~▲0.21%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、五・十日発行にあたり、鉄鋼・化学業態等から大型発行が見られ、償還額1,800億円強に対して、2,400億円弱の発行となり、やや膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。また、CP等買入オペが2,000億円でオファーされ、平均落札レート0.001%、按分落札レート▲0.001%と、平均落札レートは前回(平均0.000%按分▲0.001%)から僅かに上昇したものの、按分落札レートは横ばいの結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/11/16	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.097	0.040	0.000	22,351.12	322.80	112.75-77	113.24-25
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.112						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.120						
1M	▲ 0.045	0.460	▲ 0.004				-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.237	▲ 0.140						
6M							▲ 0.227	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.212	▲ 0.164						
									日付	11/9	11/10	11/13	11/14	11/15
									日銀当預残	3,689,000	3,688,500	3,669,100	3,676,100	3,673,200
									準備預金残	3,253,600	3,254,300	3,243,600	3,263,900	3,269,900
									マネタリーベース	4,749,800	4,748,600	4,728,200	4,734,800	4,731,700
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.044%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.045%
									コール市場残高	99,116	104,094	98,335	104,189	111,265
									うち無担	80,225	85,237	75,954	80,949	85,814
									うちO/N	47,965	53,417	45,184	49,959	56,489
									うち有担	18,891	18,857	22,381	23,240	25,451

●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	722	-	43,600	2017/11/20	2018/2/26	130,697.0	35,320.6	100.0610	▲0.2270%	5.0225%	100.0640	▲0.2382%	8,279.0
20年利付国債	162	0.60%	10,000	2017/11/20	2037/9/20	33,048.0	8,000.0	100.4500	0.5740%	80.8990%	100.4800	0.5730%	1,990.0
国有林野借入	-	-	739	2017/11/27	2022/11/25	2,767.0	739.00		0.0010%	100.0000%		0.0010%	

●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	2017/11/20	2017/12/4		2,389	2,389				
CP等買入	2,000	2017/11/21			5,932	1,972	▲0.001		0.001	60.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/11/16	2017/11/17		5	5		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月17日の予定

*米国10月の住宅着工件数

◆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