Central Daily Market Report

2017年11月20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20日 需給速報		2017年11月21日 需給予想		2017年11月22日 当社予想	
銀行券	0		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 28,300		1,200		1,000	
資金過不足	▲ 28,300		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	2,400	▲ 1,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入			8,600			
CP等買入		▲ 500	2,000			
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ＥＴＦ買入	100		200			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 27,800		15,800		▲ 1,000	

当座預金残高	3,625,800	3,641,600	3,640,600
準備預金残高	3,189,900		
積み終了先	3,184,900		
超過準備	3,175,400		
非準備預金先	435,900		

11月21日以降の残り所要積立額	
積数	23,800
1日平均	1,000

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	99.19%	日数 16.67%

●2017年11月20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4兆円減の318兆7,000億円（当座預金残高は362兆6,000億円）。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.06～▲0.045%、地銀業態から▲0.06～▲0.04%、都銀・信託業態より▲0.08～▲0.06%の調達で始まった。先週と同様に調達意欲は弱く、取り急ぐ姿は全くみられなかった。一巡後は▲0.065%近辺での出合いが散見された。ターム物は、ロール案件中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/21-11/22)は、▲0.105～▲0.095%程度、S/N(11/22-11/24)は、▲0.11～▲0.105%程度で出合いが見られた。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、5Y131、10Y336、341、347、348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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社、電力業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は550億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/11/20	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.078	0.001	▲ 0.047				－	▲ 0.100
T/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.002				－	▲ 0.102
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.032				－	▲ 0.115
2W			▲ 0.015				－	▲ 0.123
3W			▲ 0.035				－	▲ 0.124
1M			▲ 0.025				－	▲ 0.128
3M			0.000				▲ 0.243	▲ 0.139
6M							▲ 0.230	▲ 0.148
1Y							▲ 0.215	▲ 0.164

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.030	0.000	22,261.76	▲ 135.04	112.01-03	112.04-06

日付	11/13	11/14	11/15	11/16	11/17
日銀当預残	3,669,100	3,676,100	3,673,200	3,645,500	3,653,600
準備預金残	3,243,600	3,263,900	3,269,900	3,216,600	3,218,800
マネタリーベース	4,728,200	4,734,800	4,731,700	4,704,900	4,713,800
無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.048%	▲0.045%	▲0.046%	▲0.048%
コール市場残高	98,335	104,189	111,265	102,164	107,627
うち無担	75,954	80,949	85,814	80,112	85,194
うちO/N	45,184	49,959	56,489	44,557	48,334
うち有担	22,381	23,240	25,451	22,052	22,433

●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）	応募額（億円）	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ｉ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）	29,710	2017/11/20	2017/11/21		104	104		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月21日の予定

*米国10月の中古住宅販売

*流動性供給入札
（5,500億円、11/24発行）

*交付税特別会計借入
（10,500億円、11/30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。
◆本資料は何ら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論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