

Central Daily Market Report

2017年11月21日(火)

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21日		2017年11月22日		2017年11月24日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,900			▲ 2,000	
財政	900	▲ 4,400			▲ 6,000	
資金過不足	▲ 300	▲ 6,300			▲ 8,000	
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	5,000					
国債買入	8,600					
CP等買入	2,000		▲ 400			
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				
E T F 買入	200		500			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	15,200		▲ 6,000		▲ 8,000	
当座預金残高	3,641,000		3,635,000		3,627,000	
準備預金残高	3,204,500					
積み終了先	3,200,600					
超過準備	3,200,300					
非準備預金先	436,500					
11月22日以降の残り所要積立額					積数	19,600
					1日平均	800
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	99.33%	日数	20.00%		

●2017年11月21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2兆4,000億円増の321兆1,000億円(当座預金残高は364兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.065~▲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。昨日よりも地銀業態の調達意欲は弱含み、取り手は減少した。一巡後は▲0.07%近辺での出会いが見られ、本日の取引を終了した。ターム物は、ショートターム物の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/22-11/24)は、▲0.105~▲0.095%程度、S/N(11/24-11/27)は、▲0.105~▲0.10%程度で出会いが見られた。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、3M物が▲0.248~▲0.246%で散発的に出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は25日にかかる発行となり、機械、電機、商社業態からまとまった発行が見られ、総額2,500億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/11/21	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.050					-	▲ 0.102	0.025	▲ 0.005	22,416.48	154.72	112.55-56	112.56-57
T/N			0.000					-	▲ 0.102						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039					-	▲ 0.125						
2W								-	▲ 0.124						
3W								-	▲ 0.125						
1M								-	▲ 0.128						
3M								▲ 0.243	▲ 0.140						
6M								▲ 0.230	▲ 0.148						
1Y								▲ 0.215	▲ 0.164						
日付		11/14	11/15	11/16	11/17	11/20									
日銀当預残		3,676,100	3,673,200	3,645,500	3,653,600	3,625,800									
準備預金残		3,263,900	3,269,900	3,216,600	3,218,800	3,189,900									
マネタリーベース		4,734,800	4,731,700	4,704,900	4,713,800	4,686,000									
無担O/N加重平均		▲ 0.048%	▲ 0.045%	▲ 0.046%	▲ 0.048%	▲ 0.047%									
コール市場残高		104,189	111,265	102,164	107,627	99,764									
うち無担		80,949	85,814	80,112	85,194	76,516									
うちO/N		49,959	56,489	44,557	48,334	44,586									
うち有担		23,240	25,451	22,052	22,433	23,248									

●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)
流動性供給	250	-	5,500	2017/11/24		18,244.0	5,484.0		▲0.0070%	71.0492%		▲0.0090%	
交付税特会	-	-	10,500	2017/11/30	2018/5/30	167,993.0	10,500.12		0.0000%	6.2952%		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	応募総額(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
社債等買入	750	2017/11/28			2,415	750	0.012		0.022	11.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	52,131	2017/11/21	2017/11/22		163	163		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/11/24	2017/11/30	1.66	0	0				

●2017年11月22日の予定

*米国10月の耐久財新規受注

*国庫短期証券(723回)入札
(3ヶ月、44,000億円、11/27発行)

◆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