

Central Daily Market Report

2017年11月22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22日		2017年11月24日		2017年11月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 600		▲ 1,000	
財政	▲ 5,600		▲ 3,800		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 7,700		▲ 4,400		▲ 3,000	
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					2,200	▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入					9,600	
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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	500		100			
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 7,400		▲ 4,800		7,500	
当座預金残高	3,633,600		3,628,800		3,636,300	
準備預金残高	3,199,200					
積み終了先	3,196,500				11月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,196,000				積数 13,100	
非準備預金先	434,400				1日平均 600	
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	99.56%	日数	26.67%		

●2017年11月22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1兆円減の320兆1,000億円(当座預金残高は363兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.07~▲0.05%、地銀業態から▲0.065~▲0.045%、都銀・信託業態より▲0.08~▲0.07%の調達で始まった。資金調達意欲は引き続き乏しく、ギブン地合いの様相となった。一巡後は▲0.07%近辺での出合いが見られた。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/24~11/27)は、▲0.105~▲0.095%程度、S/N(11/27~11/28)は、▲0.105~▲0.10%程度で出合いが見られた。S/NはTDB3M物の発行日にあたるが、業者の売物は限定的となっている。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、3M(723回)の入札が実施された。WI取引において▲0.26%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2538%、按分落札利回▲0.2456%と、海外勢の需要期待を反映した強い結果になった。セカンダリーでは、▲0.263~▲0.26%の出合いと強含みで推移した。その他には、6M物で▲0.245%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は化学、鉄鋼業態からまとまった発行が見られ、総額1,100億円程度に達した。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/11/22	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.081	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.102	0.020	▲ 0.005	22,523.15	106.67	112.33-34	112.05-06
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.126						
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.126						
3W							-	▲ 0.126						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.128						
3M							▲ 0.259	▲ 0.139						
6M							▲ 0.235	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.216	▲ 0.164						
									日付	11/15	11/16	11/17	11/20	11/21
									日銀当預残	3,673,200	3,645,500	3,653,600	3,625,800	3,641,000
									準備預金残	3,269,900	3,216,600	3,218,800	3,189,900	3,205,500
									マネタリーベース	4,731,700	4,704,900	4,713,800	4,686,000	4,702,400
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.050%
									コール市場残高	111,265	102,164	107,627	99,764	96,623
									うち無担	85,814	80,112	85,194	76,516	76,609
									うちO/N	56,489	44,557	48,334	44,586	43,129
									うち有担	25,451	22,052	22,433	23,248	20,014

●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	723	-	44,100	2017/11/27	2018/3/5	127,936.0	35,735.80	100.0660	▲0.2456%	86.4043%	100.0682	▲0.2538%	8,364.0

●オペ結果

種類	オフター額(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	2017/11/27	2017/12/11		2,210	2,210				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/11/27			10,196	2,505	0.000		0.001	86.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/27			12,587	3,003	▲0.003		▲0.003	98.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/11/27			13,999	4,108	▲0.005		▲0.003	25.5

●2017年11月23日の予定

*勤労感謝の日	*New York祝日(Thanksgiving Day)	*英国7-9月期のGDP改定値
---------	-------------------------------	-----------------

●2017年11月24日の予定

*9月の景気動向指数改訂状況

◆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