

Central Daily Market Report

2017年11月24日(金)

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24日		2017年11月27日		2017年11月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 3,200		▲ 2,500		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 3,900		▲ 2,600		▲ 2,000	
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					2,500	
国債買入			9,700		3,200	
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100	800	
E T F買入	100		600			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 4,500		8,400		4,500	
当座預金残高	3,629,100		3,637,500		3,642,000	
準備預金残高	3,192,600					
積み終了先	3,191,600				11月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,191,100				積数	
非準備預金先	436,500				1日平均	
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		99.71%		日数	
					36.67%	

●2017年11月24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7,000億円減の319兆4,000億円(当座預金残高は362兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.065~▲0.05%、地銀業態から▲0.07~▲0.05%、都銀・信託業態より▲0.08~▲0.065%の調達で始まった。週末であるものの調達意欲は弱く、昨日同様に一巡後は▲0.07近辺での出合いが散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/27-11/28)は、▲0.105~▲0.09%程度、S/N(11/28-11/29)は、▲0.105~▲0.09%程度で出合いが見られた。S/Nは利国、短国のオベが通知されたものの、投資家の資金調達が見られたことで、レートはほぼ横ばい圏での推移となった。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、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、短国買入オベが事前予想通りの2,500億円(前回比▲2,500億円)でオフアされた。利益確定の売りが出たのか、平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.004%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.255~▲0.25%、6M物が▲0.23%で少額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。発行市場は商社業態からまとまった発行が見られ、総額1,150億円程度に達した。発行レートは一部銘柄で強めの出合いも見られたが、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/11/24	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.101	0.025	0.005	22,550.85	27.70	111.25-27	111.41-43
T/N			0.000				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.040	▲ 0.028	▲ 0.034				-	▲ 0.122						
3W							-	▲ 0.124						
1M			0.000				-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.254	▲ 0.138						
6M							▲ 0.233	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.209	▲ 0.164						
									日付	11/16	11/17	11/20	11/21	11/22
									日銀当預残	3,645,500	3,653,600	3,625,800	3,641,000	3,633,600
									準備預金残	3,216,600	3,218,800	3,189,900	3,205,500	3,199,200
									マネタリーベース	4,704,900	4,713,800	4,686,000	4,702,400	4,697,100
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.050%	▲0.054%
									コール市場残高	102,164	107,627	99,764	96,623	98,079
									うち無担	80,112	85,194	76,516	76,609	75,406
									うちO/N	44,557	48,334	44,586	43,129	41,566
									うち有担	22,052	22,433	23,248	20,014	22,673

●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)	応募率(%)	落札最低額	落札最高利回	案分率	落札平均価格	落札平均利回	第1非落札競争入札(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
国庫短期証券買入	2,500	2017/11/28			8,585	2,501	0.004		0.006	24.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/11/28			6,401	2,008	0.011		0.013	42.8
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/11/28			3,086	902	0.019		0.021	19.9
国債買入(物価連動債)	250	2017/11/28			1,022	252	▲0.100		▲0.161	11.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	26,260	2017/11/24	2017/11/27		171	171		▲0.600	▲0.600	

●2017年11月27日の予定

*10月の企業向けサービス価格指数	*米国10月の新築一戸建て販売件数
-------------------	-------------------

◆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