

Central Daily Market Report

2017年11月29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29日		2017年11月30日		2017年12月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	▲ 5,300		2,500		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 6,200		1,100		▲ 14,000	
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						
国債買入	6,100				7,000	
CP等買入		▲ 200	2,000	▲ 1,300		
貸出支援基金(成)					6,200	▲ 600
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F買入	900		800			
国債補完供給	▲ 200		200			
当預増減		200		2,800		▲ 1,400
当座預金残高	3,646,000		3,648,800		3,647,400	
準備預金残高	3,227,600					
積み終了先	3,227,100					
超過準備	3,227,100					
非準備預金先	418,400					
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額						2,946,300
準備預金進捗率						実績 99.77% 日数 46.67%

●2017年11月29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7,000億円増の322兆6,000億円(当座預金残高は364兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.06~▲0.055%、地銀業態から▲0.06~▲0.05%、都銀・信託業態より▲0.07~▲0.06%の調達で始まった。昨日同様に、一巡後は▲0.07%前後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(11/30-12/1)は、▲0.105~▲0.090%程度での出合い。S/N(12/1-12/4)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。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、2Y381・382、5Y130~133、10Y336~348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、引き続き動意なく閑散なマーケットであった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は機械、鉄鋼、ノンバンク業態等からまとまった発行が見られ、償還総額1,100億円に対して発行総額4,000億円程度と発行超となり、月初発行の入札応答日としては活況なマーケットとなった。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

2017/11/29	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.098	0.025	▲ 0.010	22,597.20	110.96	111.62-63	111.45-46
T/N			0.000				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.112						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.035				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.116						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.154						
3M			0.050				▲ 0.238	▲ 0.139						
6M							▲ 0.214	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.165						
									日付	11/21	11/22	11/24	11/27	11/28
									日銀当預残	3,641,000	3,633,600	3,629,100	3,637,500	3,645,800
									準備預金残	3,205,500	3,199,200	3,192,800	3,204,800	3,215,000
									マネタリーベース	4,702,400	4,697,100	4,693,300	4,701,700	4,710,900
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%
									コール市場残高	96,623	98,079	95,403	97,132	100,957
									うち無担	76,609	75,406	73,388	74,621	76,793
									うちO/N	43,129	41,566	42,718	43,191	45,413
									うち有担	20,014	22,673	22,015	22,511	24,164

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/12/1			11,960	4,108	▲0.004		▲0.003	73.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/12/1			4,512	2,006	▲0.005		▲0.004	99.2
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/12/1			2,007	902	▲0.010		▲0.002	60.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	5,960	2017/11/29	2017/11/30		190	190		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第30回	2017/12/1	0	6,156	45
成長基盤強化	ABL等特則第26期	2017/12/4	0	20	4
成長基盤強化	小口特則第23期	2017/12/1	0	7.19	13
成長基盤強化	米ドル特則第22期	2017/12/4		681	22
成長基盤強化	米ドル特則第18期(借り換え)	2017/12/4		3,916	36
成長基盤強化	米ドル特則第14期(借り換え)	2017/12/4		17	13
成長基盤強化	米ドル特則第10期(借り換え)	2017/12/4		136	12

●2017年11月30日の予定

*原田日銀審議委員、福島県金融経済懇話会にて講演	*米国10月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(724回)入札
*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+1.9%)	*米国11月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、44,000億円、12/4発行)
*10月の住宅着工統計	*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値	*2年利付国債入札(22,000億円、12/15発行)

◆本資料は信頼できるとさ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