

Central Daily Market Report

2017年11月30日(木)

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30日		2017年12月1日		2017年12月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,600		▲ 1,000	
財政	2,400		▲ 11,100		▲ 76,000	
資金過不足	1,000		▲ 12,700		▲ 77,000	
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					2,500	▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,100			
CP等買入	2,000	▲ 1,300		▲ 100		
貸出支援基金(成)			6,200	▲ 6,100		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入	800					
国債補完供給	▲ 500	200		500		
当預増減	2,200		▲ 5,300		▲ 76,900	
当座預金残高	3,648,200		3,642,900		3,566,000	
準備預金残高	3,212,300					
積み終了先	3,211,800				12月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,211,800				積数 6,200	
非準備預金先	435,900				1日平均 400	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					2,946,100	
準備預金進捗率	実績		99.79%		日数 50.00%	

●2017年11月30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9,000億円減の321兆7,000億円(当座預金残高は364兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.065%、地銀業態から▲0.065~▲0.05%、都銀・信託業態より▲0.07~▲0.065%の調達で始まった。月末ということもあってか昨日よりも調達がやや弱含み、一巡後は▲0.07%前後の出合いが見られた。ターム物の出合いはロール案件中心の取引であった。

<レポ市場>

GC T/N(12/1-12/4)は、▲0.095~▲0.090%程度での出合い。S/N(12/4-12/5)は、▲0.095~▲0.085%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、3M(724回)の入札が実施された。WI取引において▲0.21%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1995%、按分落札利回▲0.1712%と、債重姿勢の強まりからか予想以上に按分が流れる結果になった。セカンダリーでは、▲0.18%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。発行市場は石油、卸売業態から大型の発行が見られ、400億円程度の償還に対して発行が1,900億円程度と、発行超の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

2017/11/30	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.098	0.030	0.005	22,724.96	127.76	112.00-01	112.28-30
T/N			0.000				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.027				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.181	▲ 0.137						
6M							▲ 0.195	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.192	▲ 0.165						
									日付	11/22	11/24	11/27	11/28	11/29
									日銀当預残	3,633,600	3,629,100	3,637,500	3,645,800	3,646,000
									準備預金残	3,199,200	3,192,800	3,204,800	3,215,000	3,227,600
									マネタリーベース	4,697,100	4,693,300	4,701,700	4,710,900	4,712,100
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.053%
									コール市場残高	98,079	95,403	97,132	100,957	98,321
									うち無担	75,406	73,388	74,621	76,793	74,886
									うちO/N	41,566	42,718	43,191	45,413	44,281
									うち有担	22,673	22,015	22,511	24,164	23,435

●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	724	-	43,900	2017/12/4	2018/3/12	115,519.0	35,874.7	100.0460	▲0.1712%	17.8148%	100.0536	▲0.1995%	8,025.0
2年利付国債	383	0.10%	22,000	2017/12/15	2019/12/15	85,993.0	18,082.00	100.5300	▲0.1640%	56.8963%	100.5340	▲0.1660%	3,909.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/12/4	2017/12/18		2,492	2,492				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/11/30	2017/12/1		276	276		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	24,161	2017/11/30	2017/12/1		165	165		▲0.600	▲0.600	

●2017年12月1日の予定

- *10月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出・前年比▲0.4%)
- *10月の完全失業率(市場予想：2.8%)
- *10月の有効求人倍率(市場予想：1.53倍)
- *10月全国・11月都都区消費者物価指数(GPI)
- 市場予想：全 国(10月)前年同月比(除く生鮮)0.8%
- 市場予想：東京都区部(11月)前年同月比(除く生鮮)0.6%
- *7-9月期の法人企業統計調査季報
- *米国10月の建設支出
- *米国11月のISM製造業景況指数

◆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