

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		30日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000	0	▲ 1,000
財政		▲ 15,900	9,000	▲ 18,000
資金過不足		▲ 17,900	9,000	▲ 19,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,300	
64,865			▲ 1,600	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				2,500
国庫短期証売却				
国債買入			8,200	
CP等買入			4,500	
		▲ 700	▲ 3,500	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		▲ 500	8,900	2,500
当預増減		▲ 18,400	17,900	▲ 16,500

<< 11/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,457,800	前日比	17,900
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 27日のインターバンク市場動向 >>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆7,000億円減の181兆9,000億円(当座預金残高見込みは244兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.076~0.078%、大手行からは0.075%での調達で始まった。一巡後は、0.075%前後で散発的な出合いが見られるなか本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から2W物0.118%でまとまった調達が見られた。

<< 27日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国市場では、短国買入オペが先週に引き続きオファー額2,500億円(応札上限1,250億円)で実施され、応札額11,849億円、平均利回り較差+0.034%、按分利回り較差+0.031%(按分比率38.0%)と軟調な結果となった。オペ後は3Mで▲0.05~▲0.045%での出合いがみられた。CP市場は石油、電気機器、機械、ノンバンク等の業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,700億円程度となった。発行残高が高んだ一部銘柄にレート上昇が見られたが、年越え物については引き続き強い購入意欲が見られ、レート低下となった。

<< 30日の材料 >>

- *黒田日銀総裁、名古屋での経済界代表者との懇談にて講演
- *10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.9%)
- *10月の住宅着工統計
- *11月のシカゴPM景況感指数

当座預金残高	2,439,900	11/27以降の残り所要積立額	19,400
準備預金残高	2,222,300	11/30以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,813,900	積数	10,100
超過準備	1,813,300	1日平均	600
非準預先残高	217,600	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,964,400
準備預金進捗率	99.49% (実績)		46.67% (日数)

JGB新発10年債	0.300	0.005	日経平均株価(終値)	19,883.94	▲ 60.47	為替(9時)	122.64-65
						為替(5時)	122.39-41

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	11/19	11/20	11/24	11/25	11/26	11/27
日銀当預残	2,462,700	2,457,900	2,451,700	2,449,300	2,458,300	2,439,900
準備預金残	2,235,800	2,239,700	2,234,200	2,231,600	2,241,800	2,222,300
レート	0.078%	0.077%	0.078%	0.078%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07800%	0.07783%	0.07783%	0.07784%	0.07777%	0.07769%

11/26のマナターベース				3,434,400
11/26コール	合計	204,804	無担	64,574
			有担	140,230
コール前日増減	計	794	無担	▲ 762
			有担	1,556

11/27の加重平均レート(速報)				11/26の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分	
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.074 ~0.130 (0.091)				T/N		0.073 ~0.130 (0.087)		
				S/N				
0.100 (0.100)				1W		0.130 ~0.155 (0.143)		
0.118 (0.118)				2W		0.160 (0.160)		
				3W				
		0.07-0.12	-	1M		0.200 (0.200)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.05-▲0.045	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<< オペ情報、入札結果 >>

国短買入 2,500億円 12/1 応札 11,849億円 落札 2,500億円 按分利回り較差 0.031% 38.0% 平均利回り較差 0.034%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札11兆8,107億円落札2兆2,791億円(I非競争入札:2,204億円) 12/15~2017/12/15 ▲0.002% 按分57.7344% 平均▲0.004%
 ETF買入 362億円 約定日 11/27

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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論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