

Central Daily Market Report

2017年11月14日(火)

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14日		2017年11月15日		2017年11月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		300		▲ 1,000	
財政	▲ 2,200		▲ 1,600		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 1,300		▲ 27,000	
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	1,000					
国債買入	7,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	500		200			
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	7,000		▲ 1,600		▲ 27,000	
当座預金残高	3,676,100		3,674,500		3,647,500	
準備預金残高	3,263,900					
積み終了先	3,263,900					
超過準備	3,263,900					
非準備預金先	412,200					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,031,300	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

●2017年11月14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、前営業日比2兆8,000億円増加の326兆円5,000億円(当座預金残高見込みは367兆7,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.055~▲0.045%、地銀業態より▲0.050~▲0.040%、都銀・信託業態より▲0.060%での調達で始まった。積み最終日を明日に控えるものの、取り急ぐ動きは見られなかった。一巡後も水準に大きな変化は見られず、▲0.065%近辺の散発的な出会いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(11/15-11/16)は、▲0.085~▲0.075%程度、S/N(11/16-11/17)は、▲0.100~▲0.09%程度で出会いが見られた。S/Nは新積み期に入り、資金調達サイドが慎重な動きとなったため、前日比でレートが低下した。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5Y127、130、10Y336、341、342、347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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.22%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、償還も少なく、発行総額300億円強にとどまり、閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2017/11/14	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.095	0.045	0.000	22,380.01	▲ 0.98	113.60-61	113.73-74
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.043	0.020	▲ 0.029				-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.118						
1M	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.037				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.214	▲ 0.139						
6M							▲ 0.229	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.164						
									日付	11/7	11/8	11/9	11/10	11/13
									日銀当預残	3,683,900	3,691,300	3,689,000	3,688,500	3,669,100
									準備預金残	3,246,600	3,256,100	3,253,600	3,254,300	3,243,600
									マネタリーベース	4,746,200	4,752,400	4,749,800	4,748,600	4,728,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.045%	▲ 0.044%	▲ 0.044%	▲ 0.044%	▲ 0.048%
									コール市場残高	96,712	95,011	99,116	104,094	98,335
									うち無担	76,650	76,033	80,225	85,237	75,954
									うちO/N	44,140	43,793	47,965	53,417	45,184
									うち有担	20,062	18,978	18,891	18,857	22,381

●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)
5年利付国債	133	0.10%	22,000	2017/11/16	2022/9/20	75,427.0	18,000.0	101.0000	▲0.1050%	53.5278%	101.0100	▲0.1070%	3,991.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/11/24	2018/5/24	169,937.0	10,500.09		0.0000%	6.1789%		0.0000%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	83,355	2017/11/14	2017/11/15		203	203		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	18,050	2017/11/14	2017/11/15		29	29		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/11/16	2017/11/24	1.66	0	0				

●2017年11月15日の予定

*7-9月期のGDP1次速報
(市場予想：前期比年率+1.3%)
*9月の石油等消費動態統計

*米国9月の企業在庫
*米国10月の消費者物価指数
*米国10月の小売売上高

*国庫短期証券(721回)入札
(1年、23,000億円、11/20発行)

◆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