Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

	真金需和							
	*	2017年1	1月17日	2017年1	1月20日	2017年11月21日		
	単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
	銀行券		▲ 800		100		0	
	財政	4	1,500	•	28, 200		1,000	
F	資金過不足	1	2, 300	A	28, 100		1,000	
	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, 400	1 , 400			
	国債買現							
	国債売現							
	国庫短期証買入					5, 000		
	国債買入	10, 000				8, 500		
	CP等買入		▲ 100		▲ 500	2, 000		
	貸出支援基金(成)							
	貸出支援基金(貸)							
	被災地支援							
	社債等買入							
	ETF買入	500		100				
	国債補完供給							
	当預増減		8, 100		27, 500		16, 500	
当	座預金残高		653, 600	3,	626, 100	3,	642, 600	
	準 <u>備預金残高</u>		218, 800					
	積み終了先		200, 100		11月20日	以降の残り		
	超過準備		035, 000		積数		38, 300	
	非準備預金先		434, 800		1日平均	1, 500		
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		98. 70%	日数	13. 33%		

●2017年11月17日の市場動向

〈インターパンク市場〉

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比6,000億円増の322兆7,000億円(当座預金残高は365兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から ▲0.06~▲0.045%、地銀業態から▲0.06~▲0.035%、都銀・信託業態より ▲0.08~▲0.06%の調達希望で始まり、朝方は▲0.065~▲0.035%のレンジで出合い。一巡後もほぼ同水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の取引が散見された。

〈レポ市場〉

GC T/N(11/20-11/21)は、▲0.105~▲0.095%程度、S/N(11/21-11/22)は、 ▲0.115~▲0.100%程度で出合いが見られた。短国買入オペの影響もあり、 前日よりややレートを下げた。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、5Y126、127、130、131、10Y336、341、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短国買入オペが5,000億円で実施された。オファー額が前回から増額され、平均落札利回較差▲0.006%、按分落札利回較差▲0.008%としつかりした結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.243%、6M物が▲0.235%、1Y物が▲0.217~▲0.214%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、小売業態から大ロットでの発行が実施されたものの、発行件数も少なく、総じて閑散であった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

ICD 新祭10年债 口級亚坎华価

●短期金融市場関連指標

	無担(速報)			有担(速報)	短国	果泉 レポレート	
最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計值	平均値
▲ 0.078	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.100
						-	▲ 0.101
						-	-
▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.114
▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.032				-	▲ 0.121
						_	▲ 0.123
▲ 0.035	0.050	0.008				-	▲ 0.126
						▲ 0.242	▲ 0.140
			•			▲ 0.230	▲ 0.148
						▲ 0.215	▲ 0.164
	▲ 0.078 ▲ 0.040 ▲ 0.035	表性表高▲ 0.078■ 0.001▲ 0.040▲ 0.035▲ 0.035▲ 0.030	 最低 最高 平均 △ 0.078 ○ 0.001 △ 0.048 △ 0.049 △ 0.035 △ 0.039 △ 0.035 △ 0.030 △ 0.032 	 最低 最高 平均 最低 ▲ 0.078 0.001 ▲ 0.048 ▲ 0.040 ▲ 0.035 ▲ 0.039 ▲ 0.035 ▲ 0.032 	最低 最高 平均 最低 最高 △ 0.078 0.001 △ 0.048 △ 0.040 △ 0.035 △ 0.039 △ 0.035 △ 0.030 △ 0.032	最低 最高 平均 最低 最高 平均 ▲ 0.078 0.001 ▲ 0.048 ▲ 0.040 ▲ 0.035 ▲ 0.039 ▲ 0.035 ▲ 0.030 ▲ 0.032	最低 最高 平均 最低 最高 平均 ***********************************

J	JB新	乗10 年	-1貝	日栓平均休伽					トル/円			
直記	直近値前		日比	15	時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)		
0.0	030	A (0.010 2		0.010 22,396.80 45.68		0 22,396.80 45.68		113.04-05	112.57-58		
日付			11/	10	0 11/13		11/14		11/15	11/16		
日銀当預残			3,688,	3,60		00 3,676,1)(3,673,200	3,645,500		
準備預金残			3,254,300		3,243,600		3,263,900		3,269,900	3,216,600		
マネタ	マネタリーベース			4,748,600		4,728,200)(4,731,700	4,704,900		
無担O	無担O/N加重平均			▲0.044%		▲0.048%		39	▲0.045%	▲0.046%		
コール	コール市場残高		104,094		98,335		104,189		111,265	102,164		
	うち無担		85,237		75,954		80,949		85,814	80,112		
		うち0/N	53,	417	45,1	84	49,95	59	56,489	44,557		
うち有担		18,	857	22,381		23,240		25,451	22,052			

●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	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	第 I 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

稚類	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	5,000	2017/11/21			14,321	5,002	▲0.008		▲0.006	78.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/11/21			8,802	2,501	▲0.002		0.000	76.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/21			11,414	3,004	0.000		0.001	72.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/11/21			5,011	2,003	0.001		0.003	80.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/11/21			2,863	1,006	0.003		0.005	64.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,511	2017/11/17	2017/11/20		6	6		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/11/17	2017/11/20		25	25		▲0.500	▲0.500	

Į.	類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ	第79回	2017/11/24	2018/11/22	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第18回	2017/11/24	2018/11/22	0	0

●2017年11月20日の予定

*10月の貿易統計

- ◆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。
- 本資料は何ら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論見書をよくお読みください。

が記し金がらい成びする音画で日間で音でよくながったことできた。 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