

Central Daily Market Report

2017年11月27日(月)

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27日		2017年11月28日		2017年11月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 900		▲ 2,000	
財政	▲ 2,600		▲ 100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 2,600		▲ 1,000		▲ 3,000	
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	2,200	▲ 1,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入	9,700		3,200		6,000	
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	800			
E T F買入	600		300			
国債補充供給		200				
当預増減	8,400		5,200		3,000	
当座預金残高	3,637,500		3,642,700		3,645,700	
準備預金残高	3,204,200					
積み終了先	3,203,500		11月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,203,500		積数		7,700	
非準備預金先	433,300		1日平均		400	
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		99.74%		日数	
					40.00%	

●2017年11月27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1兆6,000億円増の321兆円(当座預金残高は363兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、証券業態から▲0.065~▲0.055%、地銀業態から▲0.07~▲0.05%、都銀・信託業態より▲0.08~▲0.065%の調達で始まった。先週より一層調達は慎重姿勢となり、取り急ぐ姿はみられなかった。一巡後は▲0.07~▲0.06%近辺での出合いが散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/28-11/29)は、▲0.095~▲0.090%程度、S/N(11/29-11/30)は、▲0.100~▲0.090%程度で出合いが見られた。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、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、動意なく閑散で6M物が▲0.23%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額1,200億円程度に対して、不動産、電力、卸売業態等から大型発行が見られ、総額2,500億円強に達し、発行超となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オベは平均落札レート0.000%となり、前回の+0.001%から僅かに低下した。按分落札レートは▲0.001%となり、横ばいの結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/11/27	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	▲ 0.053				-	▲ 0.099	0.030	0.005	22,495.99	▲ 54.86	111.66-67	111.36-37
T/N	0.000	0.010	0.008				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.035	▲ 0.027	▲ 0.033				-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.121						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.241	▲ 0.137						
6M							▲ 0.220	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.164						
									日付	11/17	11/20	11/21	11/22	11/24
									日銀当預残	3,653,600	3,625,800	3,641,000	3,633,600	3,629,100
									準備預金残	3,218,800	3,189,900	3,205,500	3,199,200	3,192,800
									マネタリーベース	4,713,800	4,686,000	4,702,400	4,697,100	4,693,300
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.047%	▲0.050%	▲0.054%	▲0.054%
									コール市場残高	107,627	99,764	96,623	98,079	95,403
									うち無担	85,194	76,516	76,609	75,406	73,388
									うちO/N	48,334	44,586	43,129	41,566	42,718
									うち有担	22,433	23,248	20,014	22,673	22,015

●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	応募総額(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1年以下)	500	2017/11/29			2,522	507	0.010		0.027	2.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/11/29			8,161	2,501	0.007		0.008	67.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/11/29			13,464	3,003	0.007		0.007	72.1
CP等買入	2,000	2017/11/30			4,740	1,987	▲0.001		0.000	89.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	15,842	2017/11/27	2017/11/28		7	7		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,993	2017/11/27	2017/11/28		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2017年11月28日の予定

*月例経済報告	*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(5,000億円、11/30発行)
	*米国11月のCB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、12/6借入)

◆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お客様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