

Central Daily Market Report

2017年11月1日(水)

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1日		2017年11月2日		2017年11月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,400		2,000	
財政	▲ 9,000		▲ 12,100		▲ 24,000	
資金過不足	▲ 9,600		▲ 13,500		▲ 22,000	
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					1,500	▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,600					
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
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		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	600		100		
当預増減	▲ 2,900		▲ 13,600		▲ 22,400	
当座預金残高	3,701,200		3,687,600		3,665,200	
準備預金残高	3,264,100					
積み終了先	3,263,900				11月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,263,800				積数	2,600
非準備預金先	437,100				1日平均	200
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,019,200
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	54.84%		

●2017年11月1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7,000億円減少の326兆3,000億円(当座預金残高見込みは370兆1,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.040%、地銀業態より▲0.045~▲0.040%、都銀・信託業態より▲0.055%での調達で始まった。月末要因が剥落し、ビッド数がやや増加したもののレート水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は調達レートが低下し、▲0.065%近辺の散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム▲0.035%程度での出合いが見られていた。固定金利方式の共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円のオフアーに対し応札額1,379億円、3M物が5,000億円のオフアーに対し応札額170億円と、それぞれ札割れとなった。

<レポ市場>

GCT/N(11/2-11/6)は▲0.170~▲0.150%程度での出合い。S/N(11/6-11/7)は▲0.150~▲0.130%程度での出合いとなった。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、個別銘柄では2Y379~381、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~56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(718回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.186~▲0.185%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1897%、按分落札利回▲0.1842%と、強めの結果となった。セカンダリーでは、▲0.204~▲0.195%で出合い、強含みで推移した。この他に、1Y物は▲0.187%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は、建設、卸売、金融機関等の業態でまとまった額の調達が見られ、償還総額700億円程度に対し、発行総額は1,500億円弱と発行超となった。発行レートは0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/11/1	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.108	0.055	▲ 0.010	22,420.08	408.47	113.64-66	113.89-91
T/N	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.153						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.035	0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.199	▲ 0.134						
6M							▲ 0.179	▲ 0.138						
1Y							▲ 0.184	▲ 0.162						
									日付	10/25	10/26	10/27	10/30	10/31
									日銀当預残	3,701,300	3,696,000	3,707,500	3,694,100	3,704,100
									準備預金残	3,266,700	3,263,600	3,268,100	3,267,900	3,257,600
									マネタリーベース	4,759,400	4,755,800	4,769,200	4,755,800	4,766,600
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.041%	▲0.039%	▲0.040%	▲0.046%
									コール市場残高	94,304	95,363	96,163	92,084	87,678
									うち無担	71,621	73,028	73,459	69,999	66,827
									うちO/N	42,726	44,033	43,144	40,234	39,667
									うち有担	22,683	22,335	22,704	22,085	20,851

●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	718	-	44,200	2017/11/6	2018/2/13	123,686.0	36,117.7	100.0500	▲0.1842%	50.4055%	100.0515	▲0.1897%	8,082.0
10年利付国債	348	0.10%	23,000	2017/11/6	2027/9/20	84,659.0	18,600.0	100.3700	0.0620%	80.1558%	100.3700	0.0620%	4,378.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/11/10	2018/5/10	178,980.0	10,500.09		0.0000%	5.8667%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/11/6	2017/11/20		1,379	1,379				
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	5,000	2017/11/6	2018/2/13		170	170				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフアーフ)	55,340	2017/11/1	2017/11/2		7	7		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフアーフ)	32,268	2017/11/1	2017/11/2		113	113		▲0.500	▲0.500	

●2017年11月2日の予定

- *10月実績/11月見込み財政資金対民間収支
- *10月のマネタリーベース
- *10月の消費動向調査
- *英中銀MPC結果発表

◆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