

Central Daily Market Report

2017年11月2日(木)
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2日 | | 2017年11月6日 | | 2017年11月7日 | |
|-------------------------|------------|--------|------------|---------|------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 1,300 | | 1,200 | | 1,000 | |
| 財政 | ▲ 2,600 | | ▲ 24,100 | | 1,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 3,900 | | ▲ 22,900 | | 2,000 | |
| 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 | | | | | 1,000 | |
| 国債買入 | | | | | 7,100 | |
| CP等買入 | | ▲ 100 | | ▲ 200 | | |
| 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 | ▲ 400 | 100 | | 400 | | |
| 当預増減 | ▲ 4,400 | | ▲ 23,100 | | 10,100 | |
| 当座預金残高 | 3,696,800 | | 3,673,700 | | 3,683,800 | |
| 準備預金残高 | 3,253,700 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,253,500 | | | | | |
| 超過準備 | 3,253,500 | | | | | |
| 非準備預金先 | 443,100 | | | | | |
| 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 | 99.95% | 日数 | 67.74% | | |

●2017年11月2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1兆3,000億円減少の325兆円(当座預金残高見込みは368兆8,000億円)。本日の無担O/N物は証券業態より▲0.045~▲0.040%、地銀業態より▲0.040%、都銀・信託業態より▲0.050%での調達で始まった。本日は税揚げ、交付税の払い等の要因があったものの、レート水準に特段の影響は見られなかった。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。

<レポ市場>

GCT/N(11/6-11/7)は▲0.120~▲0.100%程度での出合い。S/N(11/7-11/8)は▲0.160~▲0.120%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短国買入オペが1,000億円(前回比▲1,500億円)で実施された。マーケットでの品薄感を反映してか、平均落札利回較差▲0.004%、全取落札利回較差▲0.004%としっかりした結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.215~▲0.203%、6M物が▲0.198%、1Y物が▲0.192~▲0.19%で出合うなど強含みで推移した。

<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、石油、ノンバンク、卸売等の業態でまとまった額の発行が散見され、発行総額1,900億円程度と、償還総額1,400億円弱を上回った。発行レートに特段の変化は見られず、引続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

| 2017/11/2 | 無担(速報) | | | 有担(速報) | | | 短国 売買参考統計値 | 東京 レポレート 平均値 | 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 | | | | - | ▲ 0.112 | 0.050 | ▲ 0.005 | 22,539.12 | 119.04 | 114.17-18 | 114.01-02 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.108 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.035 | 0.001 | ▲ 0.012 | | | | - | ▲ 0.129 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.035 | ▲ 0.015 | ▲ 0.029 | | | | - | ▲ 0.126 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.126 | | | | | | |
| 1M | ▲ 0.040 | 0.005 | ▲ 0.029 | | | | - | ▲ 0.128 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.204 | ▲ 0.136 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.181 | ▲ 0.142 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.189 | ▲ 0.164 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 10/26 | 10/27 | 10/30 | 10/31 | 11/1 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,696,000 | 3,707,500 | 3,694,100 | 3,704,100 | 3,701,200 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,263,600 | 3,268,100 | 3,267,900 | 3,257,600 | 3,264,100 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,755,800 | 4,769,200 | 4,755,800 | 4,766,600 | 4,764,400 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.041% | ▲0.039% | ▲0.040% | ▲0.046% | ▲0.044% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 95,363 | 96,163 | 92,084 | 87,678 | 92,504 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 73,028 | 73,459 | 69,999 | 66,827 | 74,272 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 44,033 | 43,144 | 40,234 | 39,667 | 44,972 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 22,335 | 22,704 | 22,085 | 20,851 | 18,232 |

●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 | 1,000 | 2017/11/7 | | | 4,138 | 1,000 | | ▲0.004 | ▲0.004 | |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,100 | 2017/11/7 | | | 16,294 | 4,105 | ▲0.002 | | ▲0.001 | 75.8 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 2,000 | 2017/11/7 | | | 5,190 | 2,010 | 0.000 | | 0.001 | 42.4 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 1,000 | 2017/11/7 | | | 3,597 | 1,008 | ▲0.004 | | ▲0.003 | 3.5 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 53,533 | 2017/11/2 | 2017/11/6 | | 207 | 207 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 19,482 | 2017/11/2 | 2017/11/6 | | 190 | 190 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

●2017年11月3日の予定

*文化の日
*米国9月の貿易収支
*米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国10月の雇用統計
*米国10月のISM非製造業景況指数

●2017年11月6日の予定

*黒田日銀総裁、名古屋での経済界代表者との懇談会にて講演
*日銀金融政策決定会合議事要旨(9月20、21日分)
*11月の日銀当座預金増減要因見込み

◆本資料は信頼できるとさ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