

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報	18日需給予想	19日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	200	▲ 800	▲ 2,000
財政	500	▲ 2,000	▲ 27,000
資金過不足	700	▲ 2,800	▲ 29,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
64,785			
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入	15,000		
国庫短期証売却			
国債買入	8,100	900	
CP等買入			3,500
	▲ 100	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028			
被災地支援			
3,161			
社債等買入			
ETF買入			
国債補完供給	即日 ▲ 100	100	
小計	22,900	700	3,500
当預増減	23,600	▲ 2,100	▲ 25,500

<< 11/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,490,900	前日比	▲ 2,100
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 17日のインターバンク市場動向 >>
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆8,000億円増の186兆7,000億円(当座預金残高見込みは249兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.075~0.078%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は、0.07~0.075%で散発的に出合いが見られるなか本日の取引を終えた。また、本日も一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた。

<< 17日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏。短国1Y物の入札は、按分落札レート▲0.0576%(按分比率24.3238%)、平均落札レート▲0.0655%と、共に過去最低利回を更新した。セカンダリーでは▲0.10%で小額の出合いが見られた。その他では3M物で▲0.04%の出合いが見られた。CP市場は償還総額300億円程度に対し、商社等からのまとまった発行案件があり、発行総額は1,000億円程度となった。前日のCP等買入オペの影響もあり、発行レートは引き続き低位で推移した。

<< 18日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)
 *米国10月の住宅着工件数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、11/24発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、11/27借入)

<<コール10月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07684%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07700%	有担 0.03100%

当座預金残高	2,493,000	11/17以降の残り所要積立額	616,100
準備預金残高	2,267,200	11/18以降の残り所要積立額	212,300
積み終了先	1,741,700	積数	7,600
超過準備	1,459,500	1日平均	7,600
非準備先残高	225,800		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,964,600		
準備預金進捗率	89.19% (実績)	6.67% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.26-28
0.295 ▲ 0.005	19,630.63 236.94	為替(5時)	123.27-28

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	11/10	11/11	11/12	11/13	11/16	11/17
日銀当預残	2,447,600	2,477,500	2,474,800	2,489,100	2,469,400	2,493,000
準備預金残	2,224,200	2,254,400	2,254,400	2,268,100	2,248,400	2,267,200
レート	0.077%	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%
月中平均	0.07740%	0.07745%	0.07750%	0.07760%	0.07763%	0.07765%

11/16のマナタリーベース				3,436,900	
11/16コール	合計	199,094	無担	63,531	有担 135,563
コール前日増減	計	▲ 19,393	無担	▲ 19,742	有担 349

11/17の加重平均レート(速報)				11/16の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分	
0.060 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.078)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.125 (0.078)				T/N	0.073 ~0.125 (0.079)			
				S/N				
0.081 ~0.117 (0.084)				1W				
0.165 (0.165)				2W	0.145 ~0.340 (0.161)			
				3W				
0.160 (0.160)		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.04	3M				
		-	▲0.10-▲0.05	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 11/17 ~ 11/18 (1日間) 応札 101億円 落札 101億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 11/19~11/27 (8日間) 応札 400万ドル 落札 400万ドル 貸付利率 0.620%
 T-Bill1Y 応札10兆2,202億円 落札2兆2,813億9,000万円(非競争入札:2,186億円) 11/20~2016/11/21 ▲0.0576% 按分24.3238% 平均▲0.0655%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札9兆4,100億円 落札2兆2,907億円(I非競争入札:2,079億円) 11/19~2020/9/20 0.039% 按分5.7486% 平均0.037%
 預保借入(金融機能強化勘定) 875億円 11/27 ~ 2016/11/25 応札 4,385億円 落札 875億円 0.067% 按分76.818% 平均0.067%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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。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