

Central Daily Market Report

2016年11月1日(火)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2016年11月1日 需給速報	2016年11月2日 需給予想	2016年11月4日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 700	▲ 1,000
財政	▲ 1,800	▲ 800	0
資金過不足	▲ 1,900	▲ 1,500	▲ 1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入	10,000		
国債買入	5,300	11,800	
CP等買入		▲ 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			
E T F 買入		300	
国債補完供給	▲ 500	400	500
当預増減	13,300	11,000	▲ 1,000
当座預金残高	3,172,900	3,183,900	3,182,900
準備預金残高	2,861,300		
積み終了先	2,392,900		11月2日以降の残り所要積立額
超過準備	2,392,900		積数 5,000
非準備預金先	311,600		1日平均 400
積み期間 (10/16~11/15) の所要準備額			2,155,200
準備預金進捗率	実績 99.77%	日数 54.84%	

●2016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2兆円増加の239兆1,000億円(当預金残高見込みは317兆5,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態から▲0.065~▲0.045%、地銀業態から▲0.06~▲0.04%の調達希望で始まった。朝方は▲0.065~▲0.035%の出合いが中心。月初入りとなるも、ビッドサイドは総じて取り急ぎ動きは見られない印象で、一巡後は散発的な出合いにとどまった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。昨日から本日にかけて開催された日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/N(11/2~11/4)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(11/4~11/7)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、オファーサイドの資金調達ニーズが昨日に比べ一段と減退したことからオファーの厚みに欠け、レートを一時的に下げる動きとなった。SCは、ロールオーバー中心に引合いとなっており、新規のビッドは多くは見られなかった。2年・10年・30年・40年のカレント周りに引き続きタイトな銘柄が見られ、具体的な個別銘柄としては2y367~369、5y127~129、10y338、10y340~344、30y50~52、40y9にビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートT/Nは横ばい圏で推移。アウトライト市場は特段の材料も無く、閑散としていた。3M物で▲0.28%の出合いがみられた程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は400億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/1	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.089	▲ 0.054	0.001	17,442.40	17.38	104.83-84	104.93-94	
T/N	▲ 0.005	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.090							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.036	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.092							
2W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.029				-	▲ 0.095							
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.099							
1M	0.001	0.002	0.002				-	▲ 0.102							
3M							▲ 0.274	▲ 0.153							
6M							▲ 0.291	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.297	▲ 0.233							
									日付		10/25	10/26	10/27	10/28	10/31
									日銀当預残		3,175,000	3,174,500	3,160,700	3,172,600	3,159,600
									準備預金残		2,860,400	2,859,500	2,848,200	2,860,300	2,839,800
									マネタリーベース		4,188,200	4,189,000	4,176,900	4,189,900	4,176,300
									無担O/N加重平均		▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.043%	▲0.047%
									コール市場残高		83,540	84,059	85,376	90,646	79,601
									うち無担		64,558	65,577	66,084	71,721	59,714
									うち有担		18,982	18,482	19,292	18,925	19,887

●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)	募入最低値	募入最高利回	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2016/11/1	2016/11/2		227	227		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	4,300	2016/11/1	2016/11/2		304	304		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月2日の予定

*10月のマネタリーベース	*米国FOMC(2日目)	*流動性供給入札(2,000億円、11/7発行)
*10月の消費動向調査	*国庫短期証券(643回)入札	*交付税金計借入(10,500億円、11/11借入)
*10月実績/11月見込み財政資金対民間収支	(3ヶ月、44,000億円、11/7発行)	

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融政策方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとして、金利操作方針を実現するよう運営する。 (2)資産買入れ方針(賛成7反対2)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆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