

# Central Daily Market Report

2016年11月2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                   | 2016年11月2日<br>需給速報 | 2016年11月4日<br>需給予想 | 2016年11月7日<br>当社予想 |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 銀行券                     | ▲ 500              | 100                | 2,000              |
| 財政                      | ▲ 1,400            | 4,800              | ▲ 12,000           |
| 資金過不足                   | ▲ 1,900            | 4,900              | ▲ 10,000           |
| 金融調節                    | スタート               | エンド                | スタート               |
| 貸出                      |                    |                    |                    |
| 全店共通                    |                    |                    | 1,400              |
| 国債買現                    |                    |                    | ▲ 1,800            |
| 国庫短期証買入                 |                    |                    |                    |
| 国債買入                    | 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                  | ▲ 100              | 500                | 100                |
| 当預増減                    | 10,500             | 4,900              | ▲ 10,400           |
| 当座預金残高                  | 3,183,400          | 3,188,300          | 3,177,900          |
| 準備預金残高                  | 2,863,800          |                    |                    |
| 積み終了先                   | 2,398,000          |                    | 11月4日以降の残り所要積立額    |
| 超過準備                    | 2,398,000          |                    | 積数 4,300           |
| 非準備預金先                  | 319,600            |                    | 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                 | 99.80%             | 日数 61.29%          |

## ●2016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9,000億円増加の240兆円(当預金残高見込みは318兆4,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.06%、地銀・信託・証券業態から▲0.055~▲0.035%の調達希望で始まった。朝方は▲0.055~▲0.035%の出会いが中心、一巡後は▲0.065%の出会いも見られた。財政等要因で交付税の払いがあったため、地銀業態のビッドがやや少ない印象だった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(11/4~11/7)は、▲0.10~▲0.095%程度 of 出会い。S/N(11/7~11/8)は、▲0.095~▲0.085%程度 of 出会い。S/Nは、短国の発行要因から資金調達ニーズが前日に比べてやや増えたため、レートも若干上昇することとなった。SCは、ロールオーバー中心の引合いとなっており、引き続き新規のビッドは多くは見られなかった。具体的な個別銘柄としては2y367~369、5y127~129、10y338、10y340~344、30y50~52、40y91にビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートT/Nは前日よりやや低下。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。結果は平均落札利回▲0.2623%、按分落札利回▲0.2568%(按分比率68.9767%)と概ね事前予想通りの水準となった。セカンダリーは▲0.2775~▲0.27%と堅調に推移した。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、自動車、ノンバンク業態からまとまった発行が見られ、総額1,200億円程度に達した。発行レートは引続き0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/11/2 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国      | 東京<br>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 |        |    |    | -       | ▲ 0.090     | ▲ 0.064   | ▲ 0.010 | 17,134.68 | ▲ 307.72  | 104.09-12 | 103.65-66 |           |
| T/N       | ▲ 0.055 | ▲ 0.005 | ▲ 0.041 |        |    |    | -       | ▲ 0.098     |           |         |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |         |         |        |    |    | -       | -           |           |         |           |           |           |           |           |
| 1W        | ▲ 0.036 | 0.000   | ▲ 0.027 |        |    |    | -       | ▲ 0.093     |           |         |           |           |           |           |           |
| 2W        | ▲ 0.040 | 0.000   | ▲ 0.034 |        |    |    | -       | ▲ 0.095     |           |         |           |           |           |           |           |
| 3W        |         |         |         |        |    |    | -       | ▲ 0.099     |           |         |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |         | ▲ 0.031 |        |    |    | -       | ▲ 0.101     |           |         |           |           |           |           |           |
| 3M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.278 | ▲ 0.152     |           |         |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.289 | ▲ 0.225     |           |         |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.301 | ▲ 0.233     |           |         |           |           |           |           |           |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 日付        |         | 10/26     | 10/27     | 10/28     | 10/31     | 11/1      |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 日銀当預残     |         | 3,174,500 | 3,160,700 | 3,172,600 | 3,159,600 | 3,172,900 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 準備預金残     |         | 2,859,500 | 2,848,200 | 2,860,300 | 2,839,800 | 2,861,300 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | マネタリーベース  |         | 4,189,000 | 4,176,900 | 4,189,900 | 4,176,300 | 4,189,800 |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | 無担O/N加重平均 |         | ▲0.042%   | ▲0.044%   | ▲0.043%   | ▲0.047%   | ▲0.045%   |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | コール市場残高   |         | 84,059    | 85,376    | 90,646    | 79,601    | 82,961    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | うち無担      |         | 65,577    | 66,084    | 71,721    | 59,714    | 64,207    |
|           |         |         |         |        |    |    |         |             | うち有担      |         | 18,482    | 19,292    | 18,925    | 19,887    | 18,754    |

## ●入札結果

| 名称     | 回号  | 表面<br>利率 | 発行<br>予定額 | 発行日        | 償還日       | 応募額<br>(億円) | 募入額<br>(億円) | 募入<br>最低額 | 募入最高利回・利<br>回較差 | 棄分率      | 募入<br>平均価格 | 募入平均利回・利<br>回較差 | 第1非価格<br>競争入札(億円) |
|--------|-----|----------|-----------|------------|-----------|-------------|-------------|-----------|-----------------|----------|------------|-----------------|-------------------|
| 国庫短期証券 | 643 | -        | 44,000    | 2016/11/7  | 2017/2/13 | 150,153.0   | 39,914.3    | 100.0690  | ▲0.2568%        | 68.9767% | 100.0705   | ▲0.2623%        | 4,085.0           |
| 流動性供給  | 225 | -        | 2,000     | 2016/11/7  |           | 9,869.0     | 1,995.0     |           | ▲0.0130%        | 76.3417% |            | ▲0.0160%        |                   |
| 交付税特会  | -   |          | 10,500    | 2016/11/11 | 2017/5/11 | 89,389.0    | 10,500.00   |           | 0.0000%         | 14.0000% |            | 0.0000%         |                   |

## ●オペ結果

| 種類                        | オファー額<br>(億円・<br>百万ドル) | スタート日     | エンド日       | 貸付<br>利率 | 応札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 落札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 按分レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 全取レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 平均落札レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 按分<br>比率 |
|---------------------------|------------------------|-----------|------------|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|----------|
| 共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞      | 8,000                  | 2016/11/7 | 2016/11/21 |          | 1,400                 | 1,400                 |                         |                         |                           |          |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 23,996                 | 2016/11/2 | 2016/11/4  |          | 103                   | 103                   |                         | ▲0.500                  | ▲0.500                    |          |
| 米ドル資金供給                   |                        | 2016/11/4 | 2016/11/10 | 0.92     | 0                     | 0                     |                         |                         |                           |          |

## ●2016年11月3日の予定

|       |             |                                          |
|-------|-------------|------------------------------------------|
| *文化の日 | *英中銀MPC結果発表 | *米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫<br>*米国10月のISM製造業景況指数 |
|-------|-------------|------------------------------------------|

## ●2016年11月4日の予定

|                   |           |            |
|-------------------|-----------|------------|
| 11月の日銀当座預金増減要因見込み | 米国9月の貿易収支 | 米国10月の雇用統計 |
|-------------------|-----------|------------|

◆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