

Central Daily Market Report

2016年11月4日(金)

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4日		2016年11月7日		2016年11月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		1,300		3,000	
財政	2,700		▲19,400		2,000	
資金過不足	2,900		▲18,100		5,000	
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			1,400	▲1,800		
国債買現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入					7,100	
CP等買入		▲100		▲400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入			200			
国債補充供給	▲100	100		100		
当預増減	2,800		▲18,600		22,100	
当座預金残高	3,186,200		3,167,600		3,189,700	
準備預金残高	2,866,100					
積み終了先	2,400,300				11月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,400,300				積数	3,200
非準備預金先	320,100				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	99.85%	日数	70.97%		

●2016年11月4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1,000億円減少の239兆9,000億円(当預金残高見込みは318兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.065~▲0.06%、地銀・信託・証券業態から▲0.06~▲0.03%の調達希望で始まった。朝方は▲0.055~▲0.03%の出合いが中心、一巡後は▲0.07~▲0.055%の出合いが見られた。引き続き地銀業態のビッドは少ないながらも、週末要因もありレートは若干強含みで推移した。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(11/7-11/8)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(11/8-11/9)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは、日銀の短国・国債買入オペがオファーされたことから資金調達ニーズが減退し、オファーが薄い地合いが続くこととなった。SCは、新規・ロールオーバー共にビッドが多く見られた、10y・30y債のカレント周りの銘柄に新規のビッドが多く見られた。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は低水準で推移。アウトライト市場は、3Mで▲0.286~▲0.28%、6Mで▲0.305~▲0.299%、1Yで▲0.32%の出合いがみられた。短国買入オペは10,000億円度でオファーされた。結果は、平均利回較差▲0.005%、按分利回較差▲0.012%(按分比率38.0%)と需給改善を反映した結果となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は発行案件に乏しく閑散で、発行総額は200億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/4	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	▲0.070	0.010	▲0.044				-	▲0.095	▲0.065	▲0.001	16,905.36	▲229.32	103.05-06	103.23-25
T/N			0.000				-	▲0.094						
S/N							-	-						
1W	▲0.035	▲0.030	▲0.033				-	▲0.095						
2W	▲0.030	0.010	▲0.005				-	▲0.095						
3W							-	▲0.100						
1M			0.005				-	▲0.101						
3M							▲0.285	▲0.152						
6M							▲0.290	▲0.225						
1Y							▲0.301	▲0.233						
									日付	10/27	10/28	10/31	11/1	11/2
									日銀当預残	3,160,700	3,172,600	3,159,600	3,172,900	3,183,400
									準備預金残	2,848,200	2,860,300	2,839,800	2,861,300	2,864,300
									マネタリーベース	4,176,900	4,189,900	4,176,300	4,189,800	4,200,900
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.043%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.045%
									コール市場残高	85,376	90,646	79,601	82,961	93,288
									うち無担	66,084	71,721	59,714	64,207	74,900
									うち有担	19,292	18,925	19,887	18,754	18,388

●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	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
国庫短期証券買入	10,000	2016/11/8			19,888	10,001	▲0.012		▲0.005	38.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/11/8			12,623	4,108	▲0.003		▲0.001	6.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/11/8			6,983	1,912	▲0.003		▲0.002	31.0
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/11/8			3,875	1,107	▲0.009		▲0.008	90.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	17,308	2016/11/4	2016/11/7		66	66		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月7日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(9月20、21日開催分)	*米国9月の消費者信用残高
*9月の毎月勤労統計調査速報	*米国10月のFRB労働市場情勢指数

◆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