Central Daily Market Report

2016年11月8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8日 需給速報		2016年11月9日 需給予想		2016年11月10日 当社予想	
銀行券	1,400		800		1,000	
財政	4,400		100		▲ 49,000	
資金過不足	5,800		900		▲ 48,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入	7,800		9,000			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
ＥＴＦ買入	400		400			
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当預増減	23,800		10,500		▲ 48,000	

当座預金残高	3,190,900	3,201,400	3,153,400
準備預金残高	2,863,200		
積み終了先	2,401,100		
超過準備	2,401,100		
非準備預金先	327,700		

11月9日以降の残り所要積立額	
積数	2,400
1日平均	300

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			2,170,600
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数 77.42%

●2016年11月8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1兆8,000億円増額の240兆6,000億円(当預金残高見込みは319兆2,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.065～▲0.06%、地銀・証券業態から▲0.06～▲0.04%の調達希望で始まった。朝方は▲0.055～▲0.035%のレンジで出合いが見られ、一巡後は動きが乏しく本日の取引を終えた。特段取り急ぐ動きも見られず終始落ち着いていた印象であった。ターム物は、ショートタームでは引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/9-11/10)は、▲0.11～▲0.10%程度の出合い。S/N(11/10-11/11)は、▲0.10～▲0.095%程度の出合い。S/NはTDB6Mと10Yの発行日にあたり、業者の売物が増加した印象であった。SCは、個別銘柄では2y367～369、5y127～129、10y338、10y340～342、30y51～52、などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートS/Nは小幅下落。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.315～▲0.31%の出合いが見られ、平均落札利回▲0.3066%、最高落札利回▲0.2947%と概ね事前予想通りの結果になった。セカンダリーは▲0.31%～▲0.305%の出合いと小動きだった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は5・10日発行であったものの、案件に乏しく、発行総額800億円程度の出合いと閑散だった。発行レートは引続き0%近辺で推移した。CP等買入オペは3,000億円で実施された。前回から500億円減額されたものの、平均落札利回・按分落札利回共に▲0.001%と落ち着いた結果となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/8	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.044				－	▲ 0.103
T/N							－	▲ 0.105
S/N							－	－
1W	▲ 0.036	0.010	▲ 0.016				－	▲ 0.097
2W							－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.100
1M							－	▲ 0.104
3M							▲ 0.286	▲ 0.150
6M							▲ 0.306	▲ 0.225
1Y							▲ 0.297	▲ 0.233

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.070	▲ 0.015	17,171.38	▲ 5.83	104.45-47	104.41-43

日付		10/31	11/1	11/2	11/4	11/7
日銀当預残		3,159,600	3,172,900	3,183,400	3,186,200	3,167,100
準備預金残		2,839,800	2,861,300	2,864,300	2,866,400	2,848,600
マネタリーベース		4,176,300	4,189,800	4,200,900	4,203,500	4,182,900
無担O/N加重平均		▲0.047%	▲0.045%	▲0.045%	▲0.044%	▲0.044%
コール市場残高		79,601	82,961	93,288	96,090	88,471
	うち無担	59,714	64,207	74,900	78,122	70,136
	うち有担	19,887	18,754	18,388	17,968	18,335

●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）	募入額（億円）	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	644	－	35,000	2016/11/10	2017/5/12	136,925.0	31,713.7	100.1480	▲0.2947%	9.4111%	100.1540	▲0.3066%	3,286.0
10年利付国債	344	0.10%	24,000	2016/11/10	2026/9/20	94,221.0	21,657.00	101.5400	▲0.0550%	45.8142%	101.5500	▲0.0560%	2,325.0

●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
CP等買入	3,000	2016/11/11			6,065	2,950	▲0.001		▲0.001	78.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	41,581	2016/11/8	2016/11/9		384	384		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/11/10	2016/11/17	0.91	1	1				

●2016年11月9日の予定

*9月の国際収支
*9月の特定サービス産業動態統計速報
*10月の景気ウォッチャー調査
*米国9月の卸売売上高
*交付税特別会計借入
（10,500億円、11/17借入）

◆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。
◆本資料は何ら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