Central Daily Market Report

2016年11月9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9日 需給速報		2016年11月10日 需給予想		2016年11月11日 当社予想	
銀行券	800		200		0	
財政	200		▲ 49,600		3,000	
資金過不足	1,000		▲ 49,400		3,000	
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						
国債買入	9,000				4,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 300	3,000	
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					
国債補完供給	▲ 900	400		900		
当預増減	9,700		▲ 48,800		10,400	

当座預金残高	3,200,600	3,151,800	3,162,200
準備預金残高	2,870,400		
積み終了先	2,409,700		
超過準備	2,409,700		
非準備預金先	330,200		

11月10日以降の残り所要積立額	
積数	1,900
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	99.91%	日数 80.65%

●2016年11月9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8,000億円増額の241兆4,000億円(当座預金残高見込みは320兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.07～▲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▲0.06～▲0.035%のレンジで出合いが見られ、一巡後は取引閑散だった。前日同様、調達意欲が乏しくレートは低下した。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(11/10-11/11)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/N(11/11-11/14)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。T/N、S/Nともにほぼ横ばい圏内での推移。SCは、個別銘柄では2y367～369、5y127～129、10y338、10y340～344、30y51～52、などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは概ね横ばいで推移。アウトライト市場はアメリカ大統領選の経過に伴う株安債券高の流れから全般的に気配が強まった。6M物で▲0.31～▲0.305%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は機械業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は800億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/11/9	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	▲ 0.049				－	▲ 0.101
T/N			0.000				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.098
2W			▲ 0.010				－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.100
1M							－	▲ 0.105
3M							▲ 0.296	▲ 0.149
6M							▲ 0.311	▲ 0.225
1Y							▲ 0.299	▲ 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）
▲ 0.080	▲ 0.010	16,251.54	▲ 919.84	104.98-00	103.32-35

日付		11/1	11/2	11/4	11/7	11/8
日銀当預残		3,172,900	3,183,400	3,186,200	3,167,100	3,190,900
準備預金残		2,861,300	2,864,300	2,866,400	2,848,600	2,863,500
マネタリーベース		4,189,800	4,200,900	4,203,500	4,182,900	4,205,300
無担O/N加重平均		▲0.045%	▲0.045%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.044%
コール市場残高		82,961	93,288	96,090	88,471	88,953
	うち無担	64,207	74,900	78,122	70,136	70,231
	うち有担	18,754	18,388	17,968	18,335	18,722

●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)
交付税特会	－		10,500	2016/11/17	2017/5/17	86,610.0	10,500.06		0.0000%	12.1640%		0.0000%	

●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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2016/11/11			15,059	4,104	▲0.009		▲0.002	46.9
国債買入（物価連動債）	250	2016/11/11			1,225	250	▲0.130		▲0.242	40.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,628	2016/11/9	2016/11/10		901	901		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月10日の予定

*9月の機械受注統計（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲0.8%）
*金融政策決定会合における主な意見（10月31日、11月1日分）
*10月のマネーストック
*米国10月の財政収支
*国庫短期証券（645回）入札
（3ヶ月、44,000億円、11/14発行）
*30年利付国債入札
（8,000億円、11/14発行）

◆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