Central Daily Market Report

2016年11月10日（木）
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10日 需給速報		2016年11月11日 需給予想		2016年11月14日 当社予想	
銀行券		300		0		1,000
財政		▲ 49,900		5,400		▲ 18,000
資金過不足		▲ 49,600		5,400		▲ 17,000
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					1,900	▲ 2,700
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,500			
CP等買入		▲ 300	3,000	▲ 800		
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			700			
国債補完供給	▲ 100	900		100		
当預増減		▲ 49,100		12,900		▲ 17,800

当座預金残高	3,151,500	3,164,400	3,146,600
準備預金残高	2,861,300		
積み終了先	2,399,400	11月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,399,400	積数	1,400
非準備預金先	290,200	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 99.94%	日数	83.87%

●2016年11月10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2兆7,000億円減額の238兆7,000億円(当座預金残高見込みは315兆2,000億円)。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、一巡後は取引閑散ながらも▲0.07%の出合いも見られた。積み終盤となり調達サイドに一服感も見られ、レートは低下基調となっている印象であった。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(11/11-11/14)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/N(11/14-11/15)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/NはTDB3M物発行の影響で業者の売物が増加している印象であった。SCは、個別銘柄では2y367～369、5y127～129、10y338、10y340～344、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3M物の入札が実施された。株・債券相場が前日から行って来いの展開となる中、レートの上昇も予想されたが、WI取引においては▲0.2825～▲0.28%の出合いが見られ、結果は平均落札利回▲0.2765%、按分落札利回▲0.2661%と順調であった。セカンダリーは▲0.28～▲0.272%の出合いと小動きだった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は不動産、商社、建設業態からまとまった発行が見られ総額1,250億円程度に達した。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

2016/11/10	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	▲ 0.050				－	▲ 0.095
T/N			▲ 0.005				－	▲ 0.093
S/N							－	－
1W	0.000	0.120	0.058				－	▲ 0.099
2W							－	▲ 0.099
3W							－	▲ 0.101
1M							－	▲ 0.106
3M							▲ 0.276	▲ 0.149
6M							▲ 0.312	▲ 0.225
1Y							▲ 0.300	▲ 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)
▲ 0.049	0.031	17,344.42	1092.88	105.81-84	105.63-64

日付	11/2	11/4	11/7	11/8	11/9
日銀当預残	3,183,400	3,186,200	3,167,100	3,190,900	3,200,600
準備預金残	2,864,300	2,866,400	2,848,600	2,863,500	2,870,700
マネタリーベース	4,200,900	4,203,500	4,182,900	4,205,300	4,214,200
無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.049%
コール市場残高	93,288	96,090	88,471	88,953	91,354
うち無担	74,900	78,122	70,136	70,231	72,578
うち有担	18,388	17,968	18,335	18,722	18,776

●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	645	－	43,700	2016/11/14	2017/2/20	150,310.0	39,825.6	100.0715	▲0.2661%	43.7575%	100.0743	▲0.2765%	3,874.0
30年利付国債	52	0.50%	8,000	2016/11/14	2046/9/20	25,267.0	7,222.00	99.5000	0.5190%	39.9769%	99.6900	0.5110%	766.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/11/14	2016/11/28		1,901	1,901				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	16,431	2016/11/10	2016/11/11		49	49		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月11日の予定

*9月の第3次産業活動指数
*10月の企業物価指数
*New York祝日(Veterans Day)
*米国11月のミシガン大学消費者信頼感指数速報
*エネルギー対策借入（5,000億円、11/21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