Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貧金帯稻							
*	2016年1	1月14日	2016年1	1月15日	2016年1	1月16日	
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		900		500	1, 000		
財政	A	24, 500	4	3, 300	1 ,000		
資金過不足	A	23, 600	4	2, 800	0		
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			15, 000				
国債買入			11, 700				
CP等買入		▲ 500		▲ 600			
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	300		100				
国債補完供給	▲ 200			200			
当預増減	A	24, 800		23, 600		0	
当座預金残高	3,	139, 400	3,	163, 000	3,	163,000	
準備預金残高	2,	339, 100					
積み終了先		382, 500		11月15日以	以降の残り	听要積立額	
超過準備		382, 500		積数		200	
非準備預金先		300, 300		1日平均		200	
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		99.99%	日数		96. 77%	

●2016年11月14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2兆9,000億円減額の237兆 6,000億円(当座預金残高見込みは314兆円)。本日の無担O/N物は、都銀・ 信託・証券業態から▲0.08~▲0.05%、地銀業態から▲0.065~▲0.035%の 調達希望で始まり、朝方は▲0.08~▲0.035%のレンジで出合いが見られ た。積み終盤で着地の目処がついた先も見られ、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(11/15-11/16)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(11/16-11/17)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/Nは新積み期に入ったこと で一部投資家の資金調達が戻り、先日のS/Nと比べオファー増加となった。 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〉

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。アウトライト市場は、出合いの 見られない閑散としたマーケットであった。

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。発行市場は案件に乏しく、閑 散であった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/14	無担 (速報)				有担(速報)	短国	果. レポレート	
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	充實參考統計值	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.053				_	▲ 0.094
T/N		1	0.000				_	▲ 0.091
S/N							_	_
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				_	▲ 0.096
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.024				_	▲ 0.096
3W							_	▲ 0.103
1M							_	▲ 0.107
3M							▲ 0.277	▲ 0.148
6M							▲ 0.295	▲ 0.225
1Y							▲ 0.300	▲ 0.233

J(GB新多	債	日経平均株価					ドル/円			
直i	近値	前	日比	15	時時点	Ī	前日比		為替(9時)	為替(17時)	
A 0	0.020	0.0	014	17,672.62		297.83		Ĺ	106.88-89	107.64-66	
	日付		11/	7	11/8		11/9		11/10	11/11	
日銀当	預残		3,167	,100	100 3,190,90		3,200,600		3,151,500	3,164,200	
準備預	準備預金残		2,848,600		2,863,500		2,870,700		2,861,600	2,855,500	
マネタ	マネタリーベース 4		4,182,900		4,205,300		4,214,200		4,164,700	4,177,300	
無担O	無担O/N加重平均		▲0.044%		▲0.044%		▲0.049%		▲0.050%	▲0.050%	
コール	コール市場残高		88,471		88,953		91,354		94,367	94,470	
	うち無担		70,136		70,2	70,231		78	74,550	75,947	
	うち有担		18	,335	18,7	22	18,77	76	19,817	18,523	

●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)
預保借入(機能)	-	1	935	2016/11/25	2017/11/24	6,251.0	935.00		0.0000%	19.1360%		0.0000%	

●オペ結果

稚類	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	26,388	2016/11/14	2016/11/15		43	43		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/11/14	2016/11/15		200	200		▲0.600	▲0.600	

●2016年11月15日の予定

*9月の石油等消費動態統計

*10月の米小売売上高

*9月の米企業在庫

*7-9月期のユーロ圏GDP2次速報

*10月の英消費者物価指数

*5年利付国債入札 (24,000億円、11/17発行)

*国有林野借入

11/25借入) (662億円、

- ◆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