Central Daily Market Report

2016年11月15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15日 需給速報		2016年11月16日 需給予想		2016年11月17日 当社予想	
銀行券	600		0		▲ 1,000	
財政	▲ 4,000		▲ 1,200		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 3,400		▲ 1,200		▲ 26,000	
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	15,000					
国債買入	11,700					
CP等買入		▲ 600		▲ 100		
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	100		900			
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	22,700		▲ 100		▲ 26,000	

当座預金残高	3,162,100	3,162,000	3,136,000
準備預金残高	2,858,100		
積み終了先	2,401,700	11月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,401,500	積数	2,111,300
非準備預金先	304,000	1日平均	70,400
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			2,111,300
準備預金進捗率	実績 0.00%	日数	0.00%

●2016年11月15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2兆1,000億円増額の239兆7,000億円(当座預金残高見込みは316兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.07～▲0.065%、地銀・証券業態から▲0.07～▲0.035%の調達希望で始まった。積み最終日となり落ち着いた展開も予想されたものの、全体的に調達意欲はしっかりとしており、朝方は▲0.06%の出合いが中心、一巡後は▲0.05～▲0.04%まで取り上がる先も見られた。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(11/16-11/17)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(11/17-11/18)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/Nは5年債発行があったものの、運用サイドがしっかりしており、レートは前日比横ばいで推移した。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、前日と同様、動意に乏しい閑散としたマーケットとなった。

<CP市場>

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、償還は少額だったものの、商社・小売業態等から大型発行案件が実施され、1,300億円程度の規模となった。発行レートは横ばいで推移した。CP等買入オペが3,000億円オファーされ、平均落札利回▲0.002%、按分落札利回▲0.005%となった。応札額が減少した事もあり、いずれも前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/11/15	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	▲ 0.046				－	▲ 0.093
T/N			0.000				－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.009				－	▲ 0.096
2W			▲ 0.033				－	▲ 0.099
3W	0.003	0.010	0.005				－	▲ 0.102
1M							－	▲ 0.107
3M							▲ 0.277	▲ 0.148
6M							▲ 0.295	▲ 0.225
1Y							▲ 0.295	▲ 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)
0.000	0.020	17,668.15	▲ 4.47	108.20-22	108.12-14

日付	11/8	11/9	11/10	11/11	11/14
日銀当預残	3,190,900	3,200,600	3,151,500	3,164,200	3,139,400
準備預金残	2,863,500	2,870,700	2,861,600	2,855,500	2,839,100
マネタリーベース	4,205,300	4,214,200	4,164,700	4,177,300	4,151,600
無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.049%	▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%
コール市場残高	88,953	91,354	94,367	94,470	86,714
うち無担	70,231	72,578	74,550	75,947	67,291
うち有担	18,722	18,776	19,817	18,523	19,423

●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)
5年利付国債	129	0.10%	24,000	2016/11/17	2021/9/20	77,225.0	21,690.0	101.2200	▲0.1500%	43.6904%	101.2700	▲0.1600%	2,306.0
国有林野借入	－	－	662	2016/11/25	2021/11/25	2,487.0	662.00		0.0010%	50.0000%		0.0010%	

●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	2016/11/18			5,381	2,980	▲0.005		▲0.002	43.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,633	2016/11/15	2016/11/16		45	45		▲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	2016/11/15	2016/11/16		200	200		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/11/17	2016/11/25	0.91	1	1				

●2016年11月16日の予定

*米国10月の生産者物価指数
*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率
*国庫短期証券（646回）入札
（1年、25,000億円、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