

Central Daily Market Report

2016年11月16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16日		2016年11月17日		2016年11月18日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	0	▲ 900	▲ 900	▲ 900	▲ 2,000	▲ 2,000
財政	▲ 1,100	▲ 22,700	▲ 22,700	▲ 22,700	2,000	2,000
資金過不足	▲ 1,100	▲ 23,600	▲ 23,600	▲ 23,600	0	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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入					12,300	
CP等買入		▲ 100		▲ 100	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						
E T F買入	900		300			
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 200		▲ 23,200		15,300	
当座預金残高	3,161,900		3,138,700		3,154,000	
準備預金残高	2,869,100					
積み終了先	942,700				11月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	726,200				積数	424,600
非準備預金先	292,800				1日平均	14,600
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	79.89%	日数	3.33%		

●2016年11月16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1兆7,000億円増の241兆4,000億円(当座預金残高見込みは、316兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.06~▲0.035%の調達で始まった。新しい積み期間に入ったものの、取り急ぎ動きは見られず、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(11/17-11/18)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(11/18-11/21)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/Nは国債買入が通知された影響で若干レートが低下した。SCは、個別銘柄では2y367~369、5y127~129、10y338、10y340~344、20y158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。本日は1Y物の入札が実施され、平均落札利回▲0.2749%、按分落札利回▲0.2500%と概ね事前予想通りの着着となった。セカンダリー市場では、▲0.29%から▲0.38%程度まで買い進まれる展開となった。また、6Mでは▲0.25%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は、鉄鋼・商社業態等から大型発行案件が実施され、1,100億円程度の償還に対して1,300億円程度の発行となった。発行レートは、横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/16	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.092	0.015	0.015		17,862.21	194.06	109.00-04	109.42-44
T/N			0.000				-	▲ 0.089							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.025				-	▲ 0.096							
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	0.033				-	▲ 0.100							
3W							-	▲ 0.103							
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.107							
3M							▲ 0.275	▲ 0.148							
6M							▲ 0.291	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.341	▲ 0.233							
										日付	11/9	11/10	11/11	11/14	11/15
										日銀当預残	3,200,600	3,151,500	3,164,200	3,139,400	3,162,100
										準備預金残	2,870,700	2,861,600	2,855,500	2,839,100	2,858,100
										マネタリーベース	4,214,200	4,164,700	4,177,300	4,151,600	4,173,900
										無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%	▲0.046%
										コール市場残高	91,354	94,367	94,470	86,714	90,887
										うち無担	72,578	74,550	75,947	67,291	69,982
										うち有担	18,776	19,817	18,523	19,423	20,905

●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	素分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	646	-	25,000	2016/11/21	2017/11/20	84,341.0	22,796.90	100.2500	▲0.2500%	6.2222%	100.2750	▲0.2749%	2,203.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/18			12,101	4,005	0.022		0.022	89.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/18			9,616	4,202	0.014		0.016	98.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/11/18			9,392	4,102	▲0.003		▲0.001	20.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,594	2016/11/16	2016/11/17		195	195		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月17日の予定

*米国10月の消費者物価指数	*国庫短期証券(647回)入札(3ヶ月、44,000億円、11/21発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、11/28借入)
*米国10月の住宅着工件数	*20年利付国債入札(11,000億円、11/21発行)	
*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値		

◆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録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