Central Daily Market Report

2016年11月17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17日 需給速報		2016年11月18日 需給予想		2016年11月21日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 23,300		1,300		▲ 27,000	
資金過不足	▲ 24,300		200		▲ 28,000	
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					1,500	▲ 1,400
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,600			
CP等買入		▲ 100	3,000	▲ 300		
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		300			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 24,000		15,900		▲ 27,900	

当座預金残高	3,137,900	3,153,800	3,125,900
準備預金残高	2,841,000		
積み終了先	2,265,000		
超過準備	2,131,300		
非準備預金先	296,900		

11月18日以降の残り所要積立額	
積数	171,000
1日平均	6,100

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 91.90%	日数 6.67%

●2016年11月17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2兆2,000億円減の239兆2,000億円(当座預金残高見込みは、313兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.065～▲0.035%の調達で始まった。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後は、調整程度の調達が数件見られる程度で、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。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオファーされ、応札額1,510億円(期落ち分1,400億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(11/18-11/21)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(11/21-11/22)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/Nは短国3ヶ月物・1年物、20年債の発行要因が重なったものの、運用サイドがしっかりしており、レート上昇は限定的だった。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。本日は、3M新発の入札が実施された。海外需要からか、WI取引では▲0.3%と強めの水準で取引が見られ、入札結果は平均落札利回▲0.2891%、按分落札利回▲0.2716%のしっかりとした決着となった。セカンダリーでは、▲0.29～▲0.28%の出合いが見られた。6M物では▲0.275～▲0.27%で出合いが見られた。

<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、1,100億円強の償還に対して、1,500億円程度の発行が見られた。石油・鉄鋼業態等からはやや大きめの発行が実施された。発行レート水準に目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/17	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	▲ 0.080	0.010	▲ 0.045				－	▲ 0.094
T/N			0.000				－	▲ 0.097
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.032				－	▲ 0.096
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				－	▲ 0.102
3W							－	▲ 0.104
1M	▲ 0.035	▲ 0.028	▲ 0.030				－	▲ 0.110
3M							▲ 0.282	▲ 0.149
6M							▲ 0.278	▲ 0.225
1Y							▲ 0.343	▲ 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）
0.005	▲ 0.010	17,862.63	0.42	108.76-79	109.01-02

日付		11/10	11/11	11/14	11/15	11/16
日銀当預残		3,151,500	3,164,200	3,139,400	3,162,100	3,161,900
準備預金残		2,861,600	2,855,500	2,839,100	2,858,100	2,869,100
マネタリーベース		4,164,700	4,177,300	4,151,600	4,173,900	4,173,600
無担O/N加重平均		▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%	▲0.046%	▲0.048%
コール市場残高		94,367	94,470	86,714	90,887	80,785
	うち無担	74,550	75,947	67,291	69,982	61,983
	うち有担	19,817	18,523	19,423	20,905	18,802

●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	647	－	43,700	2016/11/21	2017/2/27	145,619.5	39,771.5	100.0730	▲0.2716%	39.9132%	100.0777	▲0.2891%	3,928.0
20年利付国債	158	0.50%	11,000	2016/11/21	2036/9/20	31,694.0	9,993.0	100.4000	0.4770%	71.3080%	100.8000	0.4560%	1,002.0
交付税特会	－	－	10,500	2016/11/28	2017/5/26	90,068.0	10,500.02		0.0000%	11.7347%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/11/21	2016/12/5		1,510	1,510				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	57,795	2016/11/17	2016/11/18		108	108		▲0.500	▲0.500	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間1年超3年以下）※1		2016/11/21			0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間3年超5年以下）※2		2016/11/21			0	0				

※1 国債買入（固定利回り方式）（残存期間1年超3年以下）の固定利回較差は、0.020%。この結果、2年利付国債370回の買入利回りは、-0.090%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2 国債買入（固定利回り方式）（残存期間3年超5年以下）の固定利回較差は、0.019%。この結果、5年利付国債129回の買入利回りは、-0.040%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2016年11月18日の予定

*中曽日銀副総裁、
東大・日銀共催コンファランスにて講演

◆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