

# Central Daily Market Report

2016年11月18日(金)

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18日		2016年11月21日		2016年11月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 500		▲ 2,000	
財政	1,000		▲ 33,600		2,000	
資金過不足	▲ 200		▲ 34,100		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			1,500	▲ 1,400		
国債買現						
国庫短期証買入					15,000	
国債買入	12,600				11,200	
CP等買入	3,000	▲ 300		▲ 500		
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	300					
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当増減	15,200		▲ 34,200		26,200	
当座預金残高	3,153,100		3,118,900		3,145,100	
準備預金残高	2,835,200					
積み終了先	2,374,500		11月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,334,500		積数	28,400		
非準備預金先	317,900		1日平均	1,100		
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	98.65%	日数	16.67%		

## ●2016年11月18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9,000億円減の238兆3,000億円(当座預金残高見込みは、315兆4,000億円)。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。週末の取引であるものの、レートを切り上げる動きは見られず、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、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(11/21-11/22)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(11/22-11/24)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは国債・短国買入オペアが通知されたことで売り物が減少し、レート低下となった。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。短国買入オペアは1兆5,000億円オファーされた。引け値の低い1Y中心の応札になったと見られ、平均落札利回較差+0.040%、按分落札利回較差+0.039%の結果であった。セカンダリーは3M▲0.29~▲0.275%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発行市場は機械・商社業態から大型発行案件が見られたものの、全体的に件数も少なく閑散であった。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

2016/11/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.096	0.035	0.030	17,967.41	104.78	110.23-25	110.70-71
T/N			0.000				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.010	0.020	0.005				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.288	▲ 0.149						
6M							▲ 0.276	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.338	▲ 0.233						
									日付	11/11	11/14	11/15	11/16	11/17
									日銀当預残	3,164,200	3,139,400	3,162,100	3,161,900	3,137,900
									準備預金残	2,855,500	2,839,100	2,858,100	2,869,100	2,841,000
									マネタリーベース	4,177,300	4,151,600	4,173,900	4,173,600	4,150,600
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.053%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.045%
									コール市場残高	94,470	86,714	90,887	80,785	89,260
									うち無担	75,947	67,291	69,982	61,983	69,783
									うち有担	18,523	19,423	20,905	18,802	19,477

## ●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国庫短期証券買入	15,000	2016/11/22			36,491	15,000	0.039		0.040	90.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/22			8,296	4,005	0.007		0.014	83.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/22			6,576	4,204	0.020		0.024	98.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/11/22			3,873	1,903	0.022		0.025	54.9
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/11/22			3,123	1,102	0.011		0.015	100.0
社債等買入	1,000	2016/11/25			1,676	1,000	▲0.175		▲0.124	33.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,018	2016/11/18	2016/11/21		314	314		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第67回 2016/11/25	2017/11/24	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第6回 2016/11/25	2017/11/24	0	1

## ●2016年11月21日の予定

*政井日銀審議委員、 埼玉県金融経済懇談会にて講演	*10月の貿易統計
------------------------------	-----------

◆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