Central Daily Market Report

2016年11月21日（月）
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21日 需給速報		2016年11月22日 需給予想		2016年11月24日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,300		▲ 4,000	
財政	▲ 34,700		▲ 200		1,000	
資金過不足	▲ 35,500		▲ 1,500		▲ 3,000	
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			15,000			
国債買入			11,600		4,800	
CP等買入		▲ 500		▲ 200		
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			400			
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 35,800		25,500		1,800	

当座預金残高	3,117,300	3,142,800	3,144,600
準備預金残高	2,812,400		
積み終了先	2,354,600	11月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,353,900	積数	20,500
非準備預金先	304,900	1日平均	900
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 99.03%	日数	20.00%

●2016年11月21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2兆1,000億円減少の236兆2,000億円(当座預金残高見込みは311兆9,000億円)。本日の無担O/N物は、信託業態から▲0.07～▲0.06%、証券業態等から▲0.065～▲0.04%、地銀業態から▲0.06～▲0.04%の調達希望で始まった。朝方は▲0.065～▲0.04%の出合いが中心。一巡後は▲0.06～▲0.03%のレンジで出合いが散見されたほか、一部の先から試し取りによる調達が若干見受けられた。ターム物は、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(11/22-11/24)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/N(11/24-11/25)は、▲0.10～▲0.095%程度の出合い。SCは、個別銘柄では2Y367～370、5Y127～129、10Y338、10Y340～344などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/Nは低位横ばい圏で推移。全般的に目立った材料なく閑散の中、3M物で▲0.29%の散発的な出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額250億円強に対して、発行総額は400億円程度と若干の発行超となった。発行件数は少なく、少額案件を中心とする閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/21	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	▲ 0.085	0.010	▲ 0.051				－	▲ 0.097
T/N			0.010				－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W			▲ 0.035				－	▲ 0.100
2W							－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.107
1M							－	▲ 0.111
3M							▲ 0.290	▲ 0.149
6M							▲ 0.275	▲ 0.225
1Y							▲ 0.331	▲ 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）
0.025	▲ 0.010	18,106.02	138.61	110.93-96	110.91-93

日付	11/14	11/15	11/16	11/17	11/18
日銀当預残	3,139,400	3,162,100	3,161,900	3,137,900	3,153,100
準備預金残	2,839,100	2,858,100	2,869,100	2,841,000	2,835,200
マネタリーベース	4,151,600	4,173,900	4,173,600	4,150,600	4,167,000
無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.045%	▲0.049%
コール市場残高	86,714	90,887	80,785	89,260	95,888
うち無担	67,291	69,982	61,983	69,783	77,141
うち有担	19,423	20,905	18,802	19,477	18,747

●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Ⅰ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
国債買入（残存期間1年以下）	700	2016/11/24			4,300	700		0.084	0.085	
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2016/11/24			9,792	4,105	▲0.010		▲0.006	15.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	47,270	2016/11/21	2016/11/22		139	139		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2016/11/21	2016/11/22		48	48		▲0.500	▲0.500	

●2016年11月22日の予定

*米国10月の中古住宅販売

*流動性供給入札
（5,000億円、11/25発行）

*交付税特別会計借入
（10,500億円、12/2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