Central Daily Market Report

2016年11月22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22日 需給速報		2016年11月24日 需給予想		2016年11月25日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	▲ 300		1,400		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 1,700		▲ 200		▲ 7,000	
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	11,600		4,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 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					1,000	
ＥＴＦ買入	400					
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	25,100		4,700		▲ 6,000	
当座預金残高	3,142,400		3,147,100		3,141,100	
準備預金残高	2,829,100					
積み終了先	2,379,300					
超過準備	2,377,700					
非準備預金先	313,300					

11月24日以降の残り所要積立額	
積数	14,600
1日平均	700

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	99.31%	日数 26.67%

●2016年11月22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2兆7,000億円増加の238兆9,000億円(当座預金残高見込みは314兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.075～▲0.065%、証券業態等から▲0.065～▲0.04%、地銀業態から▲0.075～▲0.06%の調達希望で始まった。昨日に引き続き各業態の調達意欲は低く、朝方は▲0.075～▲0.065%の出合いが中心。一巡後は▲0.07～▲0.03%のレンジで出合いが散見される程度であった。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T/N(11/24-11/25)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(11/25-11/28)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物は低位横ばい圏で推移。短国市場は、店頭の買いが見られ、3Mで▲0.29～▲0.289%、6Mで▲0.285～▲0.27%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、五・十日に係る発行となり、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、償還総額1,100億円程度に対し発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは低位横ばい圏での取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/22	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	0.001	▲ 0.053				－	▲ 0.096
T/N			0.000				－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.101
2W							－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.107
1M							－	▲ 0.113
3M							▲ 0.290	▲ 0.150
6M							▲ 0.275	▲ 0.225
1Y							▲ 0.322	▲ 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	0.000	18,162.94	56.92	110.67-69	110.91-93

日付	11/15	11/16	11/17	11/18	11/21
日銀当預残	3,162,100	3,161,900	3,137,900	3,153,100	3,117,300
準備預金残	2,858,100	2,869,100	2,841,000	2,835,200	2,812,400
マネタリーベース	4,173,900	4,173,600	4,150,600	4,167,000	4,132,000
無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.045%	▲0.049%	▲0.051%
コール市場残高	90,887	80,785	89,260	95,888	82,512
うち無担	69,982	61,983	69,783	77,141	63,399
うち有担	20,905	18,802	19,477	18,747	19,113

●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)
流動性供給	226	－	5,000	2016/11/25		15,612.0	4,978.0		▲0.0120%	87.4901%		▲0.0140%	
交付税特会	－	－	10,500	2016/12/2	2018/6/2	97,152.0	10,500.02		0.0000%	10.8401%		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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	70,260	2016/11/22	2016/11/24		116	116		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	15,311	2016/11/22	2016/11/24		58	58		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/11/25	2016/12/1	0.91	0	0				

●2016年11月23日の予定

*勤労感謝の日　*米国10月の新築一戸建て販売件数　*米国10月の耐久財新規受注

●2016年11月24日の予定

*9月の景気動向指数改訂状況　*New York祝日（Thanksgiving Day）　*国庫短期証券（648回）入札（3か月、44,000億円、11/28発行）

◆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