

Central Daily Market Report

2016年11月24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24日		2016年11月25日		2016年11月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 900		▲ 1,000	
財政	1,400		▲ 900		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 200		▲ 1,800		▲ 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					3,000	▲ 2,100
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,900				12,300	
CP等買入		▲ 200		▲ 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			1,000	▲ 200		
E T F買入			300			
国債補充供給	▲ 100	200		100		
当増減	4,600		▲ 1,100		6,200	
当座預金残高	3,147,000		3,145,900		3,152,100	
準備預金残高	2,833,500					
積み終了先	2,383,700				11月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,383,700				積数	13,400
非準備預金先	313,500				1日平均	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	99.37%	日数	30.00%		

●2016年11月24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、前営業日比5,000億円減の238兆4,000億円(当座預金残高見込みは、314兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.075~▲0.065%の調達で始まった。前営業日と同様調達意欲が弱く、一巡後は▲0.07%台後半での出会いが散見される中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いはなく、閑散であった。共通担保資金供給オペアは2本オファーされ、2W物8,000億円のオファーに対しては2,851億円の落札(期落ち額1,901億円)・3M物5,000億円のオファーに対しては100億円の落札(期落ち額150億円)といずれも札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(11/25-11/28)は、▲0.10~▲0.09%程度のお合い。S/N(11/28-11/29)は、▲0.09~▲0.085%程度のお合い。S/Nは、短国の発行要因から若干レートを切り上げた。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、3M物の入札が実施された。海外勢の需要からか、WI取引で3M▲0.295%での出会いが見られ、入札結果は平均落札利回▲0.2873%・按分落札利回▲0.2754%と堅調であった。セカンダリーでは3M▲0.295~▲0.285%、6M▲0.29%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、償還総額200億円程度に対し発行総額は450億円程度に膨らんだが、全体的に静かな取引となった。発行レートは引き続き低位横ばいでの動きとなった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.020	▲ 0.054				-	▲ 0.096	0.030	0.005	18,333.41	170.47	112.55-56	113.31-33
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.003	▲ 0.020				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.105						
3W	▲ 0.028	0.000	▲ 0.019				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.295	▲ 0.149						
6M							▲ 0.282	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.316	▲ 0.233						
									日付	11/16	11/17	11/18	11/21	11/22
									日銀当預残	3,161,900	3,137,900	3,153,100	3,117,300	3,142,400
									準備預金残	2,869,100	2,841,000	2,835,200	2,812,400	2,829,200
									マネタリーベース	4,173,600	4,150,600	4,167,000	4,132,000	4,158,600
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.045%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.053%
									コール市場残高	80,785	89,260	95,888	82,512	82,370
									うち無担	61,983	69,783	77,141	63,399	62,674
									うち有担	18,802	19,477	18,747	19,113	19,696

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	648	-	44,200	2016/11/28	2017/3/6	146,714.0	40,151.40	100.0740	▲0.2754%	21.3435%	100.0772	▲0.2873%	4,048.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/11/28	2016/12/12		2,851	2,851				
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	5,000	2016/11/28	2017/3/6		100	100				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/28			8,093	4,004	0.003		0.005	98.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/28			10,365	4,207	0.006		0.007	97.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/11/28			12,536	4,111	0.010		0.011	45.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	28,121	2016/11/24	2016/11/25		51	51		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	13,690	2016/11/24	2016/11/25		15	15		▲0.600	▲0.600	

●2016年11月25日の予定

*月例経済報告	*英国7-9月期のGDP改定値
*10月の企業向けサービス価格指数	*40年利付国債入札
*10月全国・11月都区部消費者物価指数(GPI)	(5,000億円、11/29発行)
市場予想：全 国(10月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%	
東京都都区部(11月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%	

◆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