Central Daily Market Report

2016年11月25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25日 需給速報		2016年11月28日 需給予想		2016年11月29日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 300		▲ 1,000	
財政	▲ 2,000		▲ 7,300		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 2,800		▲ 7,600		▲ 5,000	
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					10,000	
国債買入			12,400			
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	1,000	▲ 200				
ＥＴＦ買入	300		100			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 2,200		5,700		5,000	

当座預金残高	3,144,800	3,150,500	3,155,500
準備預金残高	2,822,600		
積み終了先	2,371,300	11月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,371,300	積数	10,200
非準備預金先	322,200	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 99.52%	日数	40.00%

●2016年11月25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6,000億円減の237兆8,000億円(当座預金残高見込みは、314兆6,000億円)。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。週末の取引であるものの調達意欲は弱く、一巡後は調整での調達もほとんど見られず、閑散な地合いの中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが数件見られた。

<レポ市場>

GC T/N(11/28-11/29)は、▲0.10～▲0.085%程度の出合い。S/N(11/29-11/30)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。SCは、個別銘柄では2Y367～370、5Y127～129、10Y335～344などカレント近辺の銘柄にビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は、3Mで▲0.305～▲0.30%、6Mで▲0.30%、1Yで▲0.31%の出合いが見られた。短国買入オペが10,000億円で実施され、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.009%と、好需給を反映した堅調な結果となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。不動産・鉄鋼・電力等、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、入札ベースでの償還総額1,200億円程度に対し、全体の発行総額は3,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは低位横ばいで推移。CP等買入オペがオファー額3,500億円（前回比500億円増額）で実施され、入札結果は平均落札利回▲0.001%・按分落札利回▲0.004%と前回比で小幅上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/25	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	0.001	▲ 0.054				－	▲ 0.097
T/N							－	▲ 0.095
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.105
2W							－	▲ 0.107
3W							－	▲ 0.110
1M							－	▲ 0.115
3M							▲ 0.300	▲ 0.150
6M							▲ 0.287	▲ 0.230
1Y							▲ 0.307	▲ 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)
0.033	0.003	18,381.22	47.81	113.26-29	113.13-15

日付	11/17	11/18	11/21	11/22	11/24
日銀当預残	3,137,900	3,153,100	3,117,300	3,142,400	3,147,000
準備預金残	2,841,000	2,835,200	2,812,400	2,829,200	2,833,500
マネタリーベース	4,150,600	4,167,000	4,132,000	4,158,600	4,164,800
無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.054%
コール市場残高	89,260	95,888	82,512	82,370	83,999
うち無担	69,783	77,141	63,399	62,674	64,926
うち有担	19,477	18,747	19,113	19,696	19,073

●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)
40年利付国債	9	0.40%	5,000	2016/11/29	2056/3/20	14,881.0	4,997.0		0.7250%	26.5037%			

●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	10,000	2016/11/29			18,547	10,000	▲0.009		▲0.001	62.0
CP等買入	3,500	2016/11/30			6,684	3,487	▲0.004		▲0.001	26.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	25,790	2016/11/25	2016/11/28		43	43		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	3,690	2016/11/25	2016/11/28		15	15		▲0.600	▲0.600	

●2016年11月28日の予定

*特にありません。

◆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