

# Central Daily Market Report

2016年11月28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28日		2016年11月29日		2016年11月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,300		▲ 1,200	
財政	▲ 7,800		0		13,700	
資金過不足	▲ 8,300		▲ 1,300		12,500	
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				7,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 500	3,500	
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	100					
国債補完供給	▲ 800	100		800		
当預増減	4,200		9,000		23,400	
当座預金残高	3,149,000		3,158,000		3,181,400	
準備預金残高	2,833,500					
積み終了先	2,383,300					11月29日以降の残り所要積立額
超過準備	2,383,300					積数
非準備預金先	315,500					1日平均
						500
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	99.57%	日数	43.33%		

## ●2016年11月28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1兆5,000億円増の239兆3,000億円(当座預金残高見込みは、315兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.075~▲0.035%の幅広いレンジでの出会いが始まった。一巡後は、朝方と同水準のレートで散發的な出会いが見られる中、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。

### <レポ市場>

GC T/N(11/29-11/30)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(11/30-12/1)は、▲0.125~▲0.115%程度の出合い。S/Nは、月末要因からオファーサイドの資金調達意欲が弱く、レートは低下した。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。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は低位横ばい圏で推移。全般的に動意なく閑散の中、3M物で▲0.304%で少額の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

CP市場は月末発行となったことで、幅広い業態からの発行が実施された。発行案件数は膨らんだものの、前営業日に前倒しの月末発行が実施されたため、償還総額6,500億円強に対し、発行総額は7,000億円強にとどまった。発行レートは概ね低位横ばいで推移したものの、一部の期内物や発行残高が積み上がっている銘柄では小幅に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/11/28	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.096	0.010	▲ 0.023	18,356.89	▲ 24.33	112.65-68	111.93-95
T/N	▲ 0.005	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.107						
2W							-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.300	▲ 0.150						
6M							▲ 0.289	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.304	▲ 0.228						
									日付	11/18	11/21	11/22	11/24	11/25
									日銀当預残	3,153,100	3,117,300	3,142,400	3,147,000	3,144,800
									準備預金残	2,835,200	2,812,400	2,829,200	2,833,500	2,823,000
									マネタリーベース	4,167,000	4,132,000	4,158,600	4,164,800	4,163,300
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.054%	▲0.054%
									コール市場残高	95,888	82,512	82,370	83,999	86,572
									うち無担	77,141	63,399	62,674	64,926	67,139
									うち有担	18,747	19,113	19,696	19,073	19,433

## ●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	棄分率	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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/11/30			9,530	4,106	▲0.027		▲0.024	29.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/11/30			5,540	1,903	▲0.027		▲0.024	69.2
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/11/30			2,342	1,100	▲0.049		▲0.041	80.3
国債買入(物価連動債)	250	2016/11/30			1,252	251	▲0.210		▲0.268	86.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2016/11/28	2016/11/29		107	107		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	83,162	2016/11/28	2016/11/29		687	687		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年11月29日の予定

*10月の完全失業率(市場予想: 3.0%)	*米国7-9月期のGDP改定値	*2年利付国債入札(23,000億円、12/15発行)
*10月の有効求人倍率(市場予想: 1.39倍)	*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
*10月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出・前年比▲0.6%)	*米国11月のCB消費者信頼感指数	
*10月の商業動態統計速報		

◆本資料は信頼できるとさ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