Central Daily Market Report

2016年11月29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29日 需給速報		2016年11月30日 需給予想		2016年12月1日 当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 2,000		13,700		▲ 14,000	
資金過不足	▲ 3,300		12,600		▲ 16,000	
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	10,000					
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 1,800		
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						
国債補完供給	▲ 100	800		100		
当預増減	6,900		22,400		▲ 16,000	

当座預金残高	3,155,900	3,178,300	3,162,300
準備預金残高	2,828,900		
積み終了先	2,385,700		
超過準備	2,385,700		
非準備預金先	327,000		

11月30日以降の残り所要積立額	
積数	8,200
1日平均	500

積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			2,111,600
準備預金進捗率	実績	99.61%	日数 46.67%

●2016年11月29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4,000億円減の238兆9,000億円(当座預金残高見込みは、315兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、邦銀、証券業態による▲0.075～▲0.035%の幅広いレンジでの出合いで始まった。一巡後もレート水準は変わらず、調整程度の出合いが散見される中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/30-12/1)は、▲0.11～▲0.095%程度の出合い。S/N(12/1-12/2)は、▲0.10～▲0.095%程度の出合い。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。全般的に動意無く閑散の中、3M物で▲0.324～▲0.31%での出合いが散見された程度であった。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額100億円弱に対して、発行総額は2,700億円程度と大きく発行超となった。配当金・賞与等の資金調達ニーズからか、発行件数が増加し、後ろ倒しの月末発行もあったためマーケットはやや活況であった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/29	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	▲ 0.052				－	▲ 0.098
T/N							－	▲ 0.103
S/N							－	－
1W	▲ 0.034	▲ 0.030	▲ 0.032				－	▲ 0.104
2W			▲ 0.034				－	▲ 0.107
3W							－	▲ 0.111
1M							－	▲ 0.137
3M							▲ 0.321	▲ 0.150
6M							▲ 0.292	▲ 0.225
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228

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)
0.010	0.000	18,307.04	▲ 49.85	111.67-69	112.31-32

日付		11/21	11/22	11/24	11/25	11/28
日銀当預残		3,117,300	3,142,400	3,147,000	3,144,800	3,149,000
準備預金残		2,812,400	2,829,200	2,833,500	2,823,000	2,833,700
マネタリーベース		4,132,000	4,158,600	4,164,800	4,163,300	4,168,000
無担O/N加重平均		▲0.051%	▲0.053%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.054%
コール市場残高		82,512	82,370	83,999	86,572	82,062
	うち無担	63,399	62,674	64,926	67,139	62,602
	うち有担	19,113	19,696	19,073	19,433	19,460

●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)
2年利付国債	371	0.10%	23,000	2016/12/15	2018/12/15	88,954.0	20,809.00	100.5100	▲0.1540%	92.3208%	100.5140	▲0.1560%	2,184.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	30,000	2016/11/29	2016/11/30		58	58		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/12/1	2016/12/8	0.89	0	0				

●2016年11月30日の予定

*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
（市場予想：前月比▲0.1%）
*10月の住宅着工統計
*米国ベージュブック
*米国10月の個人所得・消費支出
*米国11月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値
*交付税特別会計借入
（10,500億円、12/9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