

Central Daily Market Report

2016年11月30日(水)

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30日		2016年12月1日		2016年12月2日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	▲ 1,100	▲ 1,700	▲ 1,100	▲ 1,700	▲ 1,100	▲ 2,000
財政	12,500	▲ 9,000	▲ 9,000	▲ 9,000	▲ 9,000	▲ 58,000
資金過不足	11,400	▲ 10,700	▲ 10,700	▲ 10,700	▲ 10,700	▲ 60,000
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						
国債買入	8,000				11,200	
CP等買入	3,500	▲ 1,800		▲ 200		
貸出支援基金(成)					6,200	▲ 1,600
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	21,100	▲ 10,800	▲ 10,800	▲ 10,800	▲ 10,800	▲ 44,200
当座預金残高	3,177,000		3,166,200		3,122,000	
準備預金残高	2,838,800					
積み終了先	2,394,000					
超過準備	2,393,800					
非準備預金先	338,200					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額						2,110,900
準備預金進捗率	実績	99.65%	日数	50.00%		

●2016年11月30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1兆2,000億円増の240兆1,000億円(当座預金残高見込みは、317兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.08~▲0.035%の幅広いレンジでの出合いで始まった。月末の取引であるが、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、今月の取引を終えた。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(12/1-12/2)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/N(12/2-12/3)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、30Y49~30Y52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。売り物が少なく全般的に閑散の中、3M物で▲0.35%での少額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600億円強に対して、発行総額は1,900億円程度と発行超。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、一部で大型案件も見られたためマーケットはやや活況となった。

●短期金融市場関連指標

2016/11/30	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.105	0.015	0.005	18,308.48	1.44	112.46-48	112.72-73
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.021				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.336	▲ 0.149						
6M							▲ 0.293	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	11/22	11/24	11/25	11/28	11/29
									日銀当預残	3,142,400	3,147,000	3,144,800	3,149,000	3,155,900
									準備預金残	2,829,200	2,833,500	2,823,000	2,833,700	2,829,900
									マネタリーベース	4,158,600	4,164,800	4,163,300	4,168,000	4,176,200
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.052%
									コール市場残高	82,370	83,999	86,572	82,062	89,229
									うち無担	62,674	64,926	67,139	62,602	69,732
									うち有担	19,696	19,073	19,433	19,460	19,497

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2016/12/9	2017/6/9	119,217.0	10,500.08		0.0000%	8.8290%		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)	貸付率	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	貸付先数
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/12/2			9,095	4,008	0.003	▲0.003	0.001	43.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/12/2			9,392	4,204	0.005		0.006	87.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/12/2			6,300	1,903	0.009		0.010	69.8
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/12/2			3,571	1,111	▲0.003		▲0.001	7.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	48,047	2016/11/30	2016/12/1		68	68		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化	本則第26回	2016/12/2	2020/12/2	0	5,630	53				
成長基盤強化	本則第14回(借り換え)	2016/12/2	2017/12/1	0	562	43				
成長基盤強化	ABL等特別第22期	2016/12/5	2020/12/4	0	39	3				
成長基盤強化	小口特別第19期	2016/12/2	2020/12/2	0	13.12	14				
成長基盤強化	小口特別第7期(借り換え)	2016/12/2	2017/12/1	0	2.43	8				
成長基盤強化	米ドル特別第18期	2016/12/2	2017/12/4		4,000	36				
成長基盤強化	米ドル特別第14期(借り換え)	2016/12/2	2017/12/4		20	16				
成長基盤強化	米ドル特別第10期(借り換え)	2016/12/2	2017/12/4		172	13				
成長基盤強化	米ドル特別第6期(借り換え)	2016/12/2	2017/12/4		723	20				

●2016年12月1日の予定

*櫻井日銀審議委員、 滋賀県金融経済懇話会にて講演	*米国10月の建設支出 *米国11月のISM製造業景況指数	*国庫短期証券(649回)入札 (3ヶ月、44,000億円、12/5発行)	*10年利付国債入札 (24,000億円、12/20発行)
*7-9月期の法人企業統計調査季報			

◆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お客様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