

# Central Daily Market Report

2016年11月7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7日		2016年11月8日		2016年11月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,500		1,300		2,000	
財政	▲19,700		4,900		0	
資金過不足	▲18,200		6,200		2,000	
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	1,400	▲1,800				
国債買現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入			7,800		8,900	
CP等買入		▲400		▲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						
E T F買入	200		400			
国債補完供給	▲400	100		400		
当預増減	▲19,100		24,600		10,900	
当座預金残高	3,167,100		3,191,700		3,202,600	
準備預金残高	2,848,600					
積み終了先	2,384,500			11月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,384,500			積数	2,800	
非準備預金先	318,500			1日平均	300	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					2,170,600	
準備預金進捗率	実績	99.87%	日数	74.19%		

## ●2016年11月7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1兆1,000億円減少の238兆8,000億円(当預金残高見込みは316兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.065~▲0.06%、地銀・信託・証券業態から▲0.06~▲0.04%の調達希望で始まった。朝方は▲0.055~▲0.035%の出合いが中心となり、一巡後は▲0.07~▲0.065%の出合いも見られた。本日は短国等の発行要因から資金不足日であったものの、週末要因剥落から調達ニーズは限定的で落ち着いた展開となった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(11/8-11/9)は、▲0.11~▲0.10%程度の出合い。S/N(11/9-11/10)は、▲0.11~▲0.10%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が薄く、レートは低水準での推移。SCは、個別銘柄では2y367~369、5y127~129、10y338、10y340~344、30y51~52、などにビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートは概ね横ばいで推移。アウトライト市場は特段の出合いなく閑散だった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散だった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/11/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲0.070	0.001	▲0.044				-	▲0.102	▲0.055	0.010	17,177.21	271.85	104.16-19	104.43-45
T/N			0.000				-	▲0.106						
S/N							-	-						
1W	▲0.036	0.010	▲0.027				-	▲0.096						
2W							-	▲0.096						
3W							-	▲0.100						
1M			0.000				-	▲0.102						
3M							▲0.285	▲0.152						
6M							▲0.288	▲0.225						
1Y							▲0.297	▲0.233						
									日付	10/28	10/31	11/1	11/2	11/4
									日銀当預残	3,172,600	3,159,600	3,172,900	3,183,400	3,186,200
									準備預金残	2,860,300	2,839,800	2,861,300	2,864,300	2,866,400
									マネタリーベース	4,189,900	4,176,300	4,189,800	4,200,900	4,203,500
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.045%	▲0.044%
									コール市場残高	90,646	79,601	82,961	93,288	96,090
									うち無担	71,721	59,714	64,207	74,900	78,122
									うち有担	18,925	19,887	18,754	18,388	17,968

## ●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1年以下)	700	2016/11/9			3,139	700	0.017		0.039	30.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/9			13,222	4,007	0.003		0.005	5.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/9			17,217	4,204	0.007		0.007	62.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,634	2016/11/7	2016/11/8		436	436		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年11月8日の予定

*9月の景気動向指数速報	*アメリカ大統領選挙	*国庫短期証券(644回)入札 (6ヶ月、35,000億円、11/10発行)
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引		*10年利付国債入札 (24,000億円、11/10発行)

◆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