

Central Daily Market Report

2016年10月5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10月5日		2016年10月6日		2016年10月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 900		▲ 1,000	
財政	1,100		▲ 25,200		4,000	
資金過不足	1,100		▲ 26,100		3,000	
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					200	▲ 100
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,100				12,600	
CP等買入		▲ 300		▲ 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						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	9,900		▲ 26,200		15,700	
当座預金残高	3,098,200		3,072,000		3,087,700	
準備預金残高	2,779,200					
積み終了先	2,308,800				10月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,308,800				積数	3,100
非準備預金先	319,000				1日平均	300
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額						2,075,500
準備預金進捗率	実績	99.85%		日数	66.67%	

●2016年10月5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1兆5,000億円増加の232兆5,000億円(当預金残高見込みは309兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.065~▲0.06%、地銀・信託・証券業態等から▲0.04~▲0.03%の調達希望で始まった。朝方は▲0.04~▲0.02%の出合いが中心。一巡後は▲0.065~▲0.02%の幅広いレンジで出合いが見られた。ターム物は、積み期間内にエンドを迎える1W物を中心に取引が散見された。本日の固定金利方式による共通担保資金供給オペは、3M物5,000億円がオファーされ、応札額210億円(期落ち額50億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(10/6-10/7)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(10/7-10/11)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。SCはロールオーバーを中心に引合いが行われた。個別銘柄では2y366~367、5y127~129、10y340~343、20y155~158、30y49~52など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6M物の入札が実施された。入札結果は平均落札利回▲0.3743%・按分落札利回▲0.3643%と、事前予想通り堅調な結果となった。セカンダリーでは6M物で▲0.449~▲0.400%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。機械・石油・ノンバンク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900億円程度に対し、全体の発行総額は1,500億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3,500億円で実施され、入札結果は平均・按分落札利回共に▲0.001%と前回比で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2016/10/5	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.085	▲ 0.065	0.010	16,819.24	83.59	102.86-87	102.78-80
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.097						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.399	▲ 0.163						
6M							▲ 0.420	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.352	▲ 0.233						
									日付	9/28	9/29	9/30	10/3	10/4
									日銀当預残	3,129,500	3,122,800	3,118,400	3,097,100	3,088,300
									準備預金残	2,826,400	2,815,100	2,803,500	2,798,100	2,773,700
									マネタリーベース	4,138,500	4,132,600	4,128,500	4,106,100	4,096,500
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.037%	▲0.060%	▲0.044%	▲0.036%
									コール市場残高	76,788	78,982	60,211	74,048	85,836
									うち無担	56,536	59,366	50,438	52,953	65,242
									うち有担	20,252	19,616	9,773	21,095	20,594

●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)
国庫短期証券	637	-	35,000	2016/10/11	2017/4/10	132,993.0	31,762.7	100.1810	▲0.3643%	48.7046%	100.1860	▲0.3743%	3,237.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/10/14	2017/4/14	118,224.0	10,500.05		0.0010%	8.8816%		0.0010%	

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	5,000	2016/10/7	2017/1/16		210	210				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/10/7			7,989	4,001	▲0.007		▲0.004	92.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/10/7			9,547	4,207	▲0.005		▲0.003	24.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/10/7			11,926	4,107	0.005		0.006	64.0
国債買入(物価連動債)	250	2016/10/7			1,363	253	▲0.400		▲0.456	75.5
CP等買入	3,500	2016/10/11			9,474	3,489	▲0.001		▲0.001	75.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	61,827	2016/10/5	2016/10/6		131	131		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月6日の予定

*国庫短期証券(638回)入札 (3ヶ月、44,000億円、10/11発行)	*10年物価連動国債入札 (4,000億円、10/11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関す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