

Central Daily Market Report

2016年10月7日(金)

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7日		2016年10月11日		2016年10月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		700		1,000	
財政	3,900		▲ 40,300		0	
資金過不足	3,100		▲ 39,600		1,000	
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	2,000	▲ 2,500		
国債買現						
国庫短期証買入					30,000	
国債買入	12,800				7,100	
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 300		
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	1,900		200			
国債補完供給	▲ 400	100		400		
当預増減	17,100		▲ 36,300		38,100	
当座預金残高	3,089,700		3,053,400		3,091,500	
準備預金残高	2,776,700					
積み終了先	2,304,900				10月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,304,500				積数	400
非準備預金先	313,000				1日平均	100
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額						2,088,800
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	83.33%		

●2016年10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1兆1,000億円増加の230兆2,000億円(当座預金残高見込みは308兆8,000億円)。本日の無担O/Nは都銀・信託・地銀・証券を中心に▲0.03~▲0.01%近辺の調達希望で始まった。週末要因もあり、引き続き調達意欲は旺盛で、立ち上がりは同水準の出会い。一巡後もほぼ同水準の出会いが散見された。午後にかけては一服し、▲0.05~▲0.045%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/11-10/12)は、▲0.075~▲0.07%程度 of 出会い。S/N(10/12-10/13)は、▲0.075%程度 of 出会い。S/Nは、短国オベがオファーされたものの、前日からほぼ横ばい圏内でのレート推移となった。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、40y9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物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オベが30,000億円で実施され、平均落札利回較差+0.020%、按分落札利回較差+0.013%と小甘い結果となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、石油業態から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は1,000億円程度に膨らんだ。発行レートは低位横ばい圏での取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/7	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.083	▲ 0.070	▲ 0.005	16,860.09	▲ 39.01	103.75-77	103.84-86
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.095						
3W			0.020				-	▲ 0.100						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.313	▲ 0.163						
6M							▲ 0.413	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.351	▲ 0.233						
									日付	9/30	10/3	10/4	10/5	10/6
									日銀当預残	3,118,400	3,097,100	3,088,300	3,098,200	3,072,600
									準備預金残	2,803,500	2,798,100	2,773,700	2,779,200	2,769,000
									マネタリーベース	4,128,500	4,106,100	4,096,500	4,106,400	4,081,600
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.044%	▲0.036%	▲0.030%	▲0.020%
									コール市場残高	60,211	74,048	85,836	89,903	89,228
									うち無担	50,438	52,953	65,242	69,319	69,005
									うち有担	9,773	21,095	20,594	20,584	20,223

●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)
エネルギー対策	-	-	5,500	2016/10/20	2017/10/20	41,270.0	5,499.99		0.0010%	13.3270%		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
国庫短期証券買入	30,000	2016/10/12			64,158	30,004	0.013		0.020	37.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/10/12			9,015	4,108	▲0.004		▲0.003	52.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/10/12			4,658	1,906	0.006		0.007	96.6
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/10/12			3,581	1,110	0.008		0.009	88.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,817	2016/10/7	2016/10/11		340	340		▲0.500	▲0.533	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	680	2016/10/7	2016/10/11		0	0				
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	米ドル特別第17期(追加)	2016/10/14	2017/9/5	3,890	26					

●2016年10月11日の予定

*8月の国際収支	*米国9月のFRB労働市場情勢指数
*9月の景気ウォッチャー調査	

◆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