

Central Daily Market Report

2016年10月12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12日		2016年10月13日		2016年10月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		▲ 600		0	
財政	▲ 2,500		3,300		64,000	
資金過不足	▲ 1,400		2,700		64,000	
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						▲ 100
国債買現						
国庫短期証買入	30,100					
国債買入	7,400					
CP等買入		▲ 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			500			
国債補完供給	▲ 900	200		900		
当預増減	34,900		3,800		63,900	
当座預金残高	3,089,700		3,093,500		3,157,400	
準備預金残高	2,777,600					
積み終了先	2,305,600				10月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,305,600				積数	100
非準備預金先	312,100				1日平均	0
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	100.00%		日数	90.00%	

●2016年10月12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2兆1,000億円増加の230兆7,000億円(当座預金残高見込みは309兆1,000億円)。本日の無担O/Nは国内勢より▲0.05~▲0.02%の調達希望で始まった。引き続き調達ニーズが一服したことからレート低下し、立ち上がりは▲0.05~▲0.02%の出会い。一巡後は動きが乏しく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(10/13-10/14)は、▲0.075~▲0.07%程度 of 出会い。S/N(10/14-10/17)は、▲0.095~▲0.075%程度 of 出会い。S/Nは、積みの終盤で投資家の資金調達意欲の減退からオファーが出難く、レートは低下した。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は低位横ばい圏で推移。市場に目立った材料なく閑散の中、3M物で▲0.29~▲0.28%の出会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1,600億円強に対して、発行総額は1,400億円弱と償還超となった。5・10日の前倒し発行にあたり、ゴム製品・不動産業態において大型案件が散見されたものの、案件数自体はさほど多くなかった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/12	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	▲ 0.032				-	▲ 0.080	▲ 0.065	▲ 0.010	16,840.00	▲ 184.76	103.35-37	103.52-54
T/N							-	▲ 0.075						
S/N			▲ 0.023				-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.305	▲ 0.163						
6M							▲ 0.411	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.351	▲ 0.233						
									日付	10/4	10/5	10/6	10/7	10/11
									日銀当預残	3,088,300	3,098,200	3,072,600	3,089,700	3,054,800
									準備預金残	2,773,700	2,779,200	2,769,000	2,776,700	2,760,400
									マネタリーベース	4,096,500	4,106,400	4,081,600	4,099,500	4,063,700
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.030%	▲0.020%	▲0.018%	▲0.028%
									コール市場残高	85,836	89,903	89,228	88,463	81,938
									うち無担	65,242	69,319	69,005	68,710	62,104
									うち有担	20,594	20,584	20,223	19,753	19,834

●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)
30年利付国債	52	0.50%	8,000	2016/10/14	2046/9/20	26,347.0	7,229.0	99.5000	0.5190%	28.4431%	99.6300	0.5140%	763.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/10/21	2017/4/21	117,854.0	10,500.07		0.0010%	8.9095%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	38,933	2016/10/12	2016/10/13		824	824		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/10/14	2016/10/20	0.9	0	0				

●2016年10月13日の予定

*8月の第3次産業活動指数

*国庫短期証券(639回)入札
(3ヶ月、44,000億円、10/17発行)

◆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