

●資金需給

単位：億円	2016年10月14日 需給速報	2016年10月17日 需給予想	2016年10月18日 当社予想
銀行券	▲ 600	900	0
財政	62,600	▲ 15,400	▲ 26,000
資金過不足	62,000	▲ 14,500	▲ 26,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		▲ 100	1,900
国債買現			▲ 1,900
国庫短期証買入			17,500
国債買入		7,400	
CP等買入	▲ 900	▲ 900	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	▲ 200		
E T F 買入	400		
国債補完供給	1,000		
当預増減	62,200	▲ 8,000	▲ 8,600
当座預金残高	3,153,500	3,145,500	3,136,900
準備預金残高	2,828,900		
積み終了先	2,347,600	10月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,347,600	積数	494,400
非準備預金先	324,600	1日平均	16,500
積み期間 (10/16~11/15) の所要準備額			2,153,500
準備預金進捗率	実績	77.04%	日数
			3.23%

●2016年10月14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5兆3,000億円増加の235兆5,000億円(当座預金残高見込みは315兆4,000億円)。積み最終日である本日の無担O/Nは都銀・地銀業態を中心に▲0.045～▲0.02%の調達希望で始まった。年金の定時払いがあったものの、調達ニーズが残っている先もあり、▲0.04～▲0.015%が出合いの中心となった。後場にかけてはオファーサイドが薄い中、調整から▲0.01%まで取り上がる動きも見られ、本日の取引を終えた。ターム物は引き続き1Wの出合いが散見された。

＜レポ市場＞
GC T/N(10/17-10/18)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。S/N(10/18-10/19)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＞
現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。需給の悪化が意識される中、短国買入オベが1兆7,500億円でおfferされた。平均落札利回較差+0.020%、按分落札利回較差+0.016%と、需給の弱さを反映した小甘い結果となった。セカンダリー市場では特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は償還総額600億円弱に対して、発行総額は700億円強と若干の発行超となった。一部の小売業態において大型発行はあったものの、発行件数は少なく、閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/14	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.094
T/N							-	▲ 0.078
S/N							-	-
1W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.091
2W							-	▲ 0.095
3W							-	▲ 0.099
1M	▲ 0.035	0.005	▲ 0.026				-	▲ 0.101
3M							▲ 0.291	▲ 0.160
6M							▲ 0.392	▲ 0.225
1Y							▲ 0.340	▲ 0.233

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.060	0.005	16,856.37	82.13	103.73-76	104.19-21

日付	10/6	10/7	10/11	10/12	10/13
日銀当預残	3,072,600	3,089,700	3,054,800	3,089,700	3,091,300
準備預金残	2,769,000	2,776,700	2,760,400	2,777,900	2,777,200
マネタリーベース	4,081,600	4,099,500	4,063,700	4,097,500	4,099,600
無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.018%	▲0.028%	▲0.032%	▲0.032%
コール市場残高	89,228	88,463	81,938	79,499	80,543
うち無担	69,005	68,710	62,104	60,308	61,614
うち有担	20,223	19,753	19,834	19,191	18,929

●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)
5年利付国債	129	0.10%	24,000	2016/10/18	2021/9/20	93,758.0	21,751.00	101.5000	▲0.2010%	47.0353%	101.5000	▲0.2010%	2,242.0

●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	17,500	2016/10/18			40,181	17,501	0.016		0.020	92.4
社債等買入	1,000	2016/10/20			1,752	1,000	▲0.214		▲0.185	58.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,053	2016/10/14	2016/10/17		43	43		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月17日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート	*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率
*8月のマネタリーサーベイ	*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値
*8月の石油等消費動態統計	

◆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