

Central Daily Market Report

2016年10月18日(火)

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18日		2016年10月19日		2016年10月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	▲ 23,400		2,000		▲ 21,000	
資金過不足	▲ 23,400		1,000		▲ 23,000	
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	17,500					
国債買入			12,500			
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100			1,000	
ETF買入						
国債補完供給						
当増減	▲ 6,400		13,100		▲ 22,000	
当座預金残高	3,141,100		3,154,200		3,132,200	
準備預金残高	2,822,200					
積み終了先	2,286,100		10月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,247,200		積数	81,200		
非準備預金先	318,900		1日平均	2,900		
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	96.23%	日数	9.68%		

●2016年10月18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2兆1,000億円減の234兆円(当座預金残高見込みは314兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態による▲0.06~▲0.03%での調達で始まった。資金不足日にあたり、昨日と比べ調達ニーズがやや強まったものの、一巡後はオファーが薄い展開となり散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/19-10/20)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(10/20-10/21)は、▲0.085~▲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S/N物は引き続き低位で推移した。短国市場は全体的に需給が緩み、軟調な相場となっている。本日は1Y物の入札が実施された。平均落札利回▲0.3219%、按分落札利回▲0.3080%と、オベ見合いの札が入ったと見られるものの、比較的落ち着いた順調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.34%で少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は五・十日発行に当たり、鉄鋼、機械、建設業態等、複数業態でまとまった額の発行が実施された。償還総額900億円弱に対し、発行総額は3,000億円程度まで膨らんだ。発行は膨らんだものの、0%付近での買いニーズは強く、レートに特段の変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/18	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.085	▲ 0.055	0.005	16,963.61	63.49	103.85-87	103.98-00
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.033	▲ 0.005	▲ 0.025				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M			▲ 0.033				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.289	▲ 0.158						
6M							▲ 0.377	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.341	▲ 0.232						
									日付	10/11	10/12	10/13	10/14	10/17
									日銀当預残	3,054,800	3,089,700	3,091,300	3,153,500	3,147,500
									準備預金残	2,760,400	2,777,900	2,777,200	2,828,900	2,833,800
									マネタリーベース	4,063,700	4,097,500	4,099,600	4,162,400	4,155,400
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.032%	▲0.032%	▲0.035%	▲0.048%
									コール市場残高	81,938	79,499	80,543	81,034	80,731
									うち無担	62,104	60,308	61,614	62,013	61,460
									うち有担	19,834	19,191	18,929	19,021	19,271

●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	640	-	25,000	2016/10/20	2017/10/20	105,916.0	22,692.9	100.3090	▲0.3080%	21.7724%	100.3230	▲0.3219%	2,307.0
流動性供給	223	-	4,000	2016/10/20		10,743.0	3,988.00		0.0050%	15.5629%		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)	20,000	2016/10/18	2016/10/19		42	42		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/10/20	2016/10/27	0.91	1	1				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2016/10/19	2016/10/28		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2016年10月19日の予定

*米国ページブック
*米国9月の住宅着工件数

*交付税特別会計借入
(10,500億円、10/28借入)

◆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