

Central Daily Market Report

2016年10月21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21日 | | 2016年10月24日 | | 2016年10月25日 | |
|-------------------------|-------------|--------|------------------|---------|-------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 1,800 | | ▲ 300 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 2,700 | | ▲ 9,000 | | ▲ 3,000 | |
| 資金過不足 | 900 | | ▲ 9,300 | | ▲ 4,000 | |
| 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 | | | 1,800 | ▲ 2,000 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | 25,000 | |
| 国債買入 | 11,500 | | | | 5,100 | |
| CP等買入 | | ▲ 500 | 3,500 | ▲ 600 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | 200 | ▲ 100 | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| E T F買入 | 100 | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | | | 300 | | |
| 当預増減 | 11,800 | | ▲ 6,300 | | 26,100 | |
| 当座預金残高 | 3,141,200 | | 3,134,900 | | 3,161,000 | |
| 準備預金残高 | 2,826,500 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,345,700 | | 10月24日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 2,342,500 | | 積数 | | 14,100 | |
| 非準備預金先 | 314,700 | | 1日平均 | | 600 | |
| 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 | 99.35% | 日数 | 25.81% | | |

●2016年10月21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3,000億円減の233兆1,000億円(当座預金残高見込みは314兆円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態より▲0.045~▲0.04%、地銀・証券業態より▲0.04~▲0.025%での調達で始まった。週末要因もあり、引き続き調達ニーズは強かったものの、出合い一巡後はビッド水準がやや低下し、落ち着いた状況のなか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合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/24-10/25)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(10/25-10/26)は、▲0.09~▲0.085%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は同水準で推移した。本日は、短国買入オペアが事前に予想されていた下限の2兆5,000億円でおファーされた。甘くなるとの見方もあったが、結果は平均利回較差+0.021%、按分利回較差+0.012%と、予想より落ち着いた結果となった。その後は3Mで▲0.30%、1Yで▲0.335~0.325%で出合いが見られるなど、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、償還総額500億円強に対し、発行総額は1,500億円強となった。五・十日発行にあたるものの、発行件数もさほど膨らまず、大口の案件も少なかったことから、やや盛り上がり欠けるマーケットとなった。発行レートは、全体的に横ばい圏でありながらも、低下余地を探る銘柄が散見された。

●短期金融市場関連指標

| 2016/10/21 | 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 | ▲ 0.035 | | | | - | ▲ 0.085 | ▲ 0.060 | 0.009 | 17,184.59 | ▲ 50.91 | 104.11-12 | 103.83-85 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.085 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.035 | ▲ 0.030 | ▲ 0.034 | | | | - | ▲ 0.093 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.035 | 0.002 | ▲ 0.017 | | | | - | ▲ 0.095 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.099 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.101 | | | | | | |
| 3M | | | ▲ 0.025 | | | | ▲ 0.304 | ▲ 0.155 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.341 | ▲ 0.225 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.333 | ▲ 0.232 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 10/14 | 10/17 | 10/18 | 10/19 | 10/20 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,153,500 | 3,147,500 | 3,141,100 | 3,154,800 | 3,129,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 2,828,900 | 2,833,800 | 2,822,200 | 2,845,000 | 2,804,300 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,162,400 | 4,155,400 | 4,149,100 | 4,163,700 | 4,139,800 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.035% | ▲0.048% | ▲0.045% | ▲0.041% | ▲0.035% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 81,034 | 80,731 | 79,466 | 85,114 | 79,452 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 62,013 | 61,460 | 60,267 | 65,993 | 60,275 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 19,021 | 19,271 | 19,199 | 19,121 | 19,177 |

●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) | 応募額(億円) | 募入最低額 | 募入最高利回 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回 | 第1非価格競争入札(億円) |
|-----------------------------|----|------|-------|-----|-----|---------|---------|-------|--------|-----|--------|--------|---------------|
| 本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。 | | | | | | | | | | | | | |

●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 | 25,000 | 2016/10/25 | | | 39,922 | 25,001 | 0.012 | | 0.021 | 46.6 |
| 国債買入(残存期間1年以下) | 700 | 2016/10/25 | | | 3,080 | 700 | 0.014 | | 0.034 | 91.9 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,100 | 2016/10/25 | | | 14,864 | 4,107 | 0.001 | | 0.002 | 14.7 |
| 国債買入(物価連動債) | 250 | 2016/10/25 | | | 969 | 250 | ▲0.230 | | ▲0.280 | 72.9 |
| 国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分)) | 42,460 | 2016/10/21 | 2016/10/24 | | 251 | 251 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

●2016年10月24日の予定

| |
|----------------|
| *8月の景気動向指数改訂状況 |
| *9月の貿易統計 |

◆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