

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、出会い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会いが見られた。

<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%で出会いが見られるなど、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