

●資金需給

単位：億円	2016年10月24日	2016年10月25日	2016年10月26日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 8,900	11,000	1,000
資金過不足	▲ 9,400	10,500	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,800	▲ 2,000	
国債買現			
国庫短期証買入		25,100	
国債買入		5,200	
CP等買入	3,500	▲ 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		▲ 300	
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 100	300	100
当預増減	▲ 6,500	40,200	0
当座預金残高	3,134,700	3,174,900	3,174,900
準備預金残高	2,815,300		
積み終了先	2,334,600	10月25日以降の残リ所要積立額	
超過準備	2,334,600	積数	11,700
非準備預金先	319,400	1日平均	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	99.46%	日数
			29.03%

●2016年10月24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、前営業日比8,000億円増の233兆9,000億円(当座預金残高見込みは313兆5,000億円)。本日の無担〇/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.05～▲0.04%、地銀業態より▲0.05～▲0.03%での調達で始まった。週末要因の剥落により、レート水準はやや低下し、落ち着いた取引が続く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(10/25-10/26)は、▲0.095～▲0.08%程度の出合い。S/N(10/26-10/27)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。T/Nは、短国買入オペ等の要因があったものの、売り手の資金調達意欲が強く、出合いを伴いながらレートが上昇した。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、20年債158回にビッドの出入りが多く見られ、引け後までビッド残りとなっていた。

＜短国市場＞

短国現先レートT/Nは、前日から横ばい圏の取引だった。短国アウトライト市場は、3M物で▲0.31～▲0.304%の出合いが小額見られた程度で、総じて閑散だった。

＜CP市場＞

CP市場は償還総額200億円程度に対し、発行総額は800億円程度で、卸売、小売等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは、概ね0%近辺の横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/10/24	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
〇/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.085	▲ 0.059	0.001	17,234.42	49.83	103.91-93	103.91-93
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.005	▲ 0.030				-	▲ 0.093						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.100						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.308	▲ 0.155						
6M							▲ 0.335	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.332	▲ 0.232						
									日付	10/17	10/18	10/19	10/20	10/21
									日銀当預残	3,147,500	3,141,100	3,154,800	3,129,400	3,141,200
									準備預金残	2,833,800	2,822,200	2,845,000	2,804,300	2,826,500
									マネタリーベース	4,155,400	4,149,100	4,163,700	4,139,800	4,153,300
									無担〇/N加重平均	▲0.048%	▲0.045%	▲0.041%	▲0.035%	▲0.035%
									コール市場残高	80,731	79,466	85,114	79,452	78,682
									うち無担	61,460	60,267	65,993	60,275	59,781
									うち有担	19,271	19,199	19,121	19,177	18,901

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	37,504	2016/10/24	2016/10/25		88	88		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月25日の予定

*月例経済報告	*米国8月の S&P/ケース・シラー住宅価格指数 *米国10月のCB消費者信頼感指数	*20年利付国債入札 (11,000億円、10/27発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、11/2借入)
---------	--	---

◆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論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