Central Daily Market Report

2016年10月26日（水）
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26日 需給速報		2016年10月27日 需給予想		2016年10月28日 当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	1,400		▲ 12,900		0	
資金過不足	100		▲ 14,500		▲ 2,000	
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						
国債買現					11,200	
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 400	100		400		
当預増減	▲ 500		▲ 13,600		9,200	

当座預金残高	3,174,500	3,160,900	3,170,100
準備預金残高	2,859,500		
積み終了先	2,379,000		
超過準備	2,379,000		
非準備預金先	315,000		

10月27日以降の残り所要積立額	
積数	7,800
1日平均	400

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	99.64%	日数 35.48%

●2016年10月26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237兆8,000億円(当座預金残高見込みは317兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態より▲0.05～▲0.045%、地銀・証券業態より▲0.05～▲0.03%での調達で始まった。一巡後は昨日と同様に、レート水準をやや切り下げての出合いが散見される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(10/27-10/28)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N（10/28-10/31）は、▲0.095～▲0.09%程度の出合い。T/N・S/Nとも、目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内での取引となった。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、40Y9のオファーが出難く、O/N中心に締まったレベルでの取引となった。

<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～▲0.305%、1Y物で▲0.315～▲0.31%の出合いが見られたが、出合い量は少なく、閑散だった。

<CP市場>

CP市場は償還総額550億円程度に対し、発行総額は2,300億円程度だった。月末分の前倒し発行もあり、鉄鋼、石油、不動産等の業態からまとまった発行案件が見られたが、発行レートは引き続き概ね0%近辺で横ばい圏だった。CP等買入オペは、事前の予定から変わらず3,500億円でオファーされ、按分、平均レート共に▲0.001%、按分比率86.4%という結果となった。発行残高の伸び悩みを背景に、応札額は前回比で減少しており、平均レートは小幅に低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/10/26	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.042				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.094
2W	▲ 0.036	▲ 0.015	▲ 0.026				－	▲ 0.096
3W							－	▲ 0.100
1M	▲ 0.036	0.030	▲ 0.003				－	▲ 0.102
3M							▲ 0.304	▲ 0.155
6M							▲ 0.311	▲ 0.225
1Y							▲ 0.304	▲ 0.232

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）
▲ 0.069	0.000	17,391.84	26.59	104.15-16	104.17-19

日付		10/19	10/20	10/21	10/24	10/25
日銀当預残		3,154,800	3,129,400	3,141,200	3,134,700	3,175,000
準備預金残		2,845,000	2,804,300	2,826,500	2,815,300	2,860,400
マネタリーベース		4,163,700	4,139,800	4,153,300	4,147,400	4,188,200
無担O/N加重平均		▲0.041%	▲0.035%	▲0.035%	▲0.040%	▲0.041%
コール市場残高		85,114	79,452	78,682	77,273	83,540
	うち無担	65,993	60,275	59,781	58,495	64,558
	うち有担	19,121	19,177	18,901	18,778	18,982

●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Ⅰ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2016/10/28			9,339	4,005	▲0.001		0.001	34.0
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2016/10/28			13,298	4,203	▲0.001		0.000	82.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,900	2016/10/28			5,027	1,909	▲0.005		▲0.004	72.5
国債買入（残存期間25年超）	1,100	2016/10/28			2,875	1,102	▲0.011		▲0.007	78.2
CP等買入	3,500	2016/10/31			6,171	3,480	▲0.001		▲0.001	86.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	14,167	2016/10/26	2016/10/27		362	362		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2016/10/26	2016/10/27		16	16		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月27日の予定

*米国9月の耐久財新規受注
*英国7-9月期のGDP速報値
*国庫短期証券（642回）入札
（3ヶ月、44,000億円、10/31発行）
*2年利付国債入札
（23,000億円、11/15発行）

◆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