

Central Daily Market Report

2016年10月13日(木)

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13日		2016年10月14日		2016年10月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 700		1,000	
財政	1,900		62,900		▲ 7,000	
資金過不足	1,500		62,200		▲ 6,000	
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	1,900	▲ 1,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入					7,100	
CP等買入		▲ 300		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F 買入	500		400			
国債補完供給	▲ 1,000	900		1,000		
当預増減	1,600		62,400		1,100	
当座預金残高	3,091,300		3,153,700		3,154,800	
準備預金残高	2,777,200					
積み終了先	2,305,500					
超過準備	2,305,500					
非準備預金先	314,100					
			10月14日以降の残り所要積立額			
			積数		100	
			1日平均		0	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,088,800	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.33%		

●2016年10月13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5,000億円減少の230兆2,000億円(当座預金残高見込みは309兆4,000億円)。本日の無担O/Nは都銀・地銀・証券を中心に▲0.05~▲0.02%の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.05~▲0.02%の出会い。積み最終日を控え調達が一服した先も散見され、落ち着いた展開となった。一巡後は動きが乏しいまま、本日の取引を終えた。ターム物は1Wの出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/14-10/17)は、▲0.10~▲0.08%程度の出会い。S/N(10/17-10/18)は、▲0.075~▲0.065%程度の出会い。S/Nは、短国の発行要因からレートを切り上げた。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2Y366~367、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は横ばい圏で推移した。本日は新発3M物の入札が実施された。需給軟化によりレート上昇が意識される中、WI取引では▲0.315~▲0.29%の出会いが見られ、入札結果は平均落札利回▲0.2925%、按分落札利回▲0.2735%と事前予想よりもやや堅調な結果となった。セカンダリー市場では▲0.29%近辺での出会いが散見された。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額1,500億円強に対して、発行総額は1,200億円弱と償還超。後ろ倒しの5・10日発行にあたり、発行件数が増加したものの、小・中案件が中心であり、落ち着いたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/13	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	0.050	▲ 0.032				-	▲ 0.080	▲ 0.065	0.000	16,774.24	▲ 65.76	104.30-32	103.86-88
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.098						
1M	▲ 0.030	0.003	▲ 0.021				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.291	▲ 0.162						
6M							▲ 0.395	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.344	▲ 0.233						
									日付	10/5	10/6	10/7	10/11	10/12
									日銀当預残	3,098,200	3,072,600	3,089,700	3,054,800	3,089,700
									準備預金残	2,779,200	2,769,000	2,776,700	2,760,400	2,777,900
									マネタリーベース	4,106,400	4,081,600	4,099,500	4,063,700	4,097,500
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.020%	▲0.018%	▲0.028%	▲0.032%
									コール市場残高	89,903	89,228	88,463	81,938	79,499
									うち無担	69,319	69,005	68,710	62,104	60,308
									うち有担	20,584	20,223	19,753	19,834	19,191

●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	639	-	43,500	2016/10/17	2017/1/23	148,827.5	39,472.7	100.0735	▲0.2735%	42.1770%	100.0786	▲0.2925%	4,027.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/10/17	2016/10/31		1,861	1,861				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/10/17			10,801	4,106	0.000		0.001	16.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/10/17			3,990	1,906	▲0.002		0.002	14.3
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/10/17			3,115	1,103	▲0.009		▲0.005	50.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	54,457	2016/10/13	2016/10/14		967	967		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月14日の予定

*9月のマネーストック	*9月の米生産者物価指数	*5年利付国債入札(24,000億円、10/18発行)
*9月の企業物価指数	*9月の米小売売上高	
	*8月の米企業在庫	
	*10月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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