

# Central Daily Market Report

2016年10月17日(月)

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17日		2016年10月18日		2016年10月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		0		0	
財政	▲ 13,400		▲ 24,000		2,000	
資金過不足	▲ 12,500		▲ 24,000		2,000	
<b>金融調節</b>						
	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	1,900	▲ 1,900		▲ 100		
国債買現						
国庫短期証買入			17,500			
国債買入	7,400				12,300	
CP等買入		▲ 900		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 6,000		▲ 7,000		14,300	
当座預金残高	3,147,500		3,140,500		3,154,800	
準備預金残高	2,833,800					
積み終了先	2,228,500					
超過準備	2,030,500					
非準備預金先	313,700					
		10月18日以降の残り所要積立額				
		積数		173,300		
		1日平均		6,000		
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		91.95%		日数		6.45%

## ●2016年10月17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6,000億円増の236兆1,000億円(当座預金残高見込みは314兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態による▲0.065~▲0.03%での調達で始まった。新しい積み期間に入ったものの、先週末に年金定時払いがあった事から、地銀業態を中心に調達ニーズは弱く、一巡後は散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/18-10/19)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(10/19-10/20)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。動意なく閑散な地合いとなり、特段の出合いも見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は、償還総額200億円強に対し、発行総額500億円強となった。発行超となったものの、案件も少なく、閑散なマーケットであった。発行レートは0%近辺に集中していた。

## ●短期金融市場関連指標

2016/10/17	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	▲ 0.048				-	▲ 0.086	▲ 0.060	0.000	16,900.12	43.75	104.04-05	104.15-17
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.027				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.291	▲ 0.159						
6M							▲ 0.385	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.332	▲ 0.233						
		日付		10/7	10/11	10/12	10/13	10/14						
		日銀当預残		3,089,700	3,054,800	3,089,700	3,091,300	3,153,500						
		準備預金残		2,776,700	2,760,400	2,777,900	2,777,200	2,828,900						
		マネタリーベース		4,099,500	4,063,700	4,097,500	4,099,600	4,162,400						
		無担O/N加重平均		▲ 0.018%	▲ 0.028%	▲ 0.032%	▲ 0.032%	▲ 0.035%						
		コール市場残高		88,463	81,938	79,499	80,543	81,034						
		うち無担		68,710	62,104	60,308	61,614	62,013						
		うち有担		19,753	19,834	19,191	18,929	19,021						

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/10/19			10,845	4,004	0.004		0.007	8.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/10/19			10,493	4,204	0.003		0.005	9.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/10/19			10,394	4,108	0.002		0.002	96.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2016/10/17	2016/10/18		38	38		▲ 0.500	▲ 0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第66回	2016/10/21	2017/10/20	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第5回	2016/10/21	2017/10/20	158

## ●2016年10月18日の予定

*米国9月の消費者物価指数	*国庫短期証券(640回)入札(1年、25,000億円、10/20発行)	*流動性供給入札(4,000億円、10/20発行)
*英国9月の消費者物価指数		

◆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