

Central Daily Market Report

2016年10月19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19日		2016年10月20日		2016年10月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,300		▲ 2,000	
財政	2,500		▲ 24,500		1,000	
資金過不足	1,600		▲ 25,800		▲ 1,000	
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						
国庫短期証買入						
国債買入	12,500				11,200	
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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			1,000	▲ 200		
ETF買入						
国債補充供給						
当預増減	13,700		▲ 25,300		10,300	
当座預金残高	3,154,800		3,129,500		3,139,800	
準備預金残高	2,845,000					
積み終了先	2,344,500		10月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,324,800		積数		43,000	
非準備預金先	309,800		1日平均		1,600	
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	98.00%	日数	12.90%		

●2016年10月19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2兆3,000億円増の236兆3,000億円(当座預金残高見込みは315兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態より▲0.05~▲0.04%、地銀・証券業態より▲0.05~▲0.03%での調達で始まった。朝方から調達ニーズが若干強く、一巡後も水準での出合いが見ら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(10/20-10/21)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(10/21-10/24)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S/N物は引続き低位で推移した。閑散な地合いが続いており、1Y物で▲0.345%が少額出合った程度だった。

<CP市場>

CP市場は、鉱業、化学、ノンバンク業態を筆頭に、複数業態でまとまった額の調達が行われた。ただ、案件数は少なく、償還総額600億円強程度に対し、発行総額は1,700億円弱程度だった。発行レートについては、引続き0%近辺で推移している。本日は、CP等買入オベがオファー額3,500億円で実施された。平均落札利回が若干上昇し0%、按分落札利回は▲0.001%と、前回からほぼ変わらずの結果となった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/19	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	▲ 0.041				-	▲ 0.085	▲ 0.060	▲ 0.005	16,998.91	35.30	103.86-88	103.52-54
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.091						
2W							-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.287	▲ 0.158						
6M							▲ 0.367	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.343	▲ 0.232						
									日付	10/12	10/13	10/14	10/17	10/18
									日銀当預残	3,089,700	3,091,300	3,153,500	3,147,500	3,141,100
									準備預金残	2,777,900	2,777,200	2,828,900	2,833,800	2,822,200
									マネタリーベース	4,097,500	4,099,600	4,162,400	4,155,400	4,149,100
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.032%	▲0.035%	▲0.048%	▲0.045%
									コール市場残高	79,499	80,543	81,034	80,731	79,466
									うち無担	60,308	61,614	62,013	61,460	60,267
									うち有担	19,191	18,929	19,021	19,271	19,199

●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)
交付税特会	-		10,500	2016/10/28	2017/4/28	104,710.0	10,500.07		0.0010%	10.0279%		0.0010%	

●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	2016/10/21			10,664	4,004	0.005		0.005	85.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/10/21			11,175	4,206	0.000		0.000	84.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/10/21			5,375	1,906	▲0.001		0.001	47.9
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/10/21			3,550	1,105	0.000		0.002	89.7
CP等買入	3,500	2016/10/24			7,215	3,496	▲0.001		0.000	44.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2016/10/19	2016/10/20		42	42		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月20日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(641回)入札(3ヶ月、44,000億円、10/24発行)	*流動性供給入札(5,000億円、10/24発行)
*米国9月の中古住宅販売		

◆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