

Central Daily Market Report

2016年10月20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20日		2016年10月21日		2016年10月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,800		▲ 1,000	
財政	▲ 24,500		1,400		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 25,900		▲ 400		▲ 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					1,800	▲ 2,000
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,500			
CP等買入		▲ 300		▲ 500	3,500	
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			100			
国債補完供給						
当預増減	▲ 25,400		10,800		▲ 2,700	
当座預金残高	3,129,400		3,140,200		3,137,500	
準備預金残高	2,804,300					
積み終了先	2,314,800		10月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,309,000		積数		29,500	
非準備預金先	325,100		1日平均		1,100	
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	98.63%	日数	16.13%		

●2016年10月20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2兆9,000億円減の233兆4,000億円(当座預金残高見込みは313兆円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態より▲0.045~▲0.04%、地銀・証券業態より▲0.045~▲0.025%での調達で始まった。昨日に続き調達ニーズは強く、一巡後も同水準で散発的な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。固定金利方式による共通担保オペは2W物8,000億円のオファーに対し、落札額1,800億円(期落ち額2,010億円)の札割れとなった。また、本日は3市場合同BCP訓練の一環として、固定金利方式による本店共通担保資金供給オペ(O/N物)が1,000億円オファーされ、22億円の落札結果となった。

<レポ市場>

GC T/N(10/21-10/24)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(10/24-10/25)は、▲0.085~▲0.08%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物は引き続き低位で推移した。本日は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.25%でまとまった出合いが見られ、ここからのレート上昇も予想されたが、平均落札利回▲0.2545%、按分落札利回▲0.2493%とほぼ同水準の結果となった。セカンダリーでは、ショートカバーからか、一時▲0.32%まで買い進まれる展開となった。

<CP市場>

CP市場は、機械、ノンバンク業態等でまとまった額の発行が実施され、償還総額1,000億円程に対し、発行総額は1,600億円弱となった。発行レートは引き続き、0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2016/10/20	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.086	▲ 0.069	▲ 0.009	17,235.50	236.59	103.39-41	103.72-74
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.013				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.320	▲ 0.157						
6M							▲ 0.358	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.342	▲ 0.232						
									日付	10/13	10/14	10/17	10/18	10/19
									日銀当預残	3,091,300	3,153,500	3,147,500	3,141,100	3,154,800
									準備預金残	2,777,200	2,828,900	2,833,800	2,822,200	2,845,000
									マネタリーベース	4,099,600	4,162,400	4,155,400	4,149,100	4,163,700
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.035%	▲0.048%	▲0.045%	▲0.041%
									コール市場残高	80,543	81,034	80,731	79,466	85,114
									うち無担	61,614	62,013	61,460	60,267	65,993
									うち有担	18,929	19,021	19,271	19,199	19,121

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	641	-	43,800	2016/10/24	2017/1/30	165,259.0	39,863.7	100.0670	▲0.2493%	56.1211%	100.0684	▲0.2545%	3,936.0
流動性供給	224	-	5,000	2016/10/24		18,513.0	4,996.00		▲0.0110%	36.8663%		▲0.0150%	

●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	2016/10/24	2016/11/7		1,800	1,800				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/10/20	2016/10/21		45	45		▲0.500	▲0.500	
共通担保資金供給(本店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2016/10/20	2016/10/21		22	22				

●2016年10月21日の予定

*黒田日銀総裁、 全国信用組合大会にて講演	*黒田日銀総裁、 The Economist主催ジャパン・サミット2016にて講演
--------------------------	----------------------------------------------

◆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