Central Daily Market Report

2016年10月25日（火）
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25日 需給速報		2016年10月26日 需給予想		2016年10月27日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,200		▲ 2,000	
財政	11,300		1,400		▲ 12,000	
資金過不足	10,700		200		▲ 14,000	
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	25,100					
国債買入	5,200					
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						
社債等買入		▲ 300				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	40,300		0		▲ 14,000	

当座預金残高	3,175,000	3,175,000	3,161,000
準備預金残高	2,860,400		
積み終了先	2,380,200	10月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,379,900	積数	9,600
非準備預金先	314,600	1日平均	500
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 99.55%	日数	32.26%

●2016年10月25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4兆2,000億円増の238兆1,000億円(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、ビッド水準がやや低下し▲0.055～▲0.05%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、証券業態からショートタームでの調達が数件見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/26-10/27)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(10/27-10/28)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、前営業日に締まったレベルで取引されていた20年債158回が、20年債入札でリオープン発行となったことから、一転してオファー残りとなっていた。

<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▲0.315～▲0.30%の出合いが散発的に見られたが、動意に乏しく閑散だった。

<CP市場>

CP市場は償還総額200億円程度に対し、発行総額は950億円程度で、商社、鉄鋼等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは、銘柄毎のばらつきは見られたものの、概ね横ばい圏だった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/25	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				－	▲ 0.084
T/N							－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W			▲ 0.025				－	▲ 0.094
2W			▲ 0.035				－	▲ 0.096
3W							－	▲ 0.100
1M			▲ 0.030				－	▲ 0.103
3M							▲ 0.307	▲ 0.155
6M							▲ 0.322	▲ 0.225
1Y							▲ 0.314	▲ 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	▲ 0.010	17,365.25	130.83	104.31-34	104.45-47

日付		10/18	10/19	10/20	10/21	10/24
日銀当預残		3,141,100	3,154,800	3,129,400	3,141,200	3,134,700
準備預金残		2,822,200	2,845,000	2,804,300	2,826,500	2,815,300
マネタリーベース		4,149,100	4,163,700	4,139,800	4,153,300	4,147,400
無担O/N加重平均		▲0.045%	▲0.041%	▲0.035%	▲0.035%	▲0.040%
コール市場残高		79,466	85,114	79,452	78,682	77,273
	うち無担	60,267	65,993	60,275	59,781	58,495
	うち有担	19,199	19,121	19,177	18,901	18,778

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
20年利付国債	158	0.50%	11,000	2016/10/27	2036/9/20	34,558.0	9,906.0	102.4500	0.3670%	16.2584%	102.5200	0.3640%	1,088.0
交付税特会	－		10,500	2016/11/2	2017/5/2	94,843.0	10,500.07		0.0010%	11.0711%		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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	31,230	2016/10/25	2016/10/26		50	50		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/10/27	2016/11/4	0.9	0	0				

●2016年10月26日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数　　*米国9月の新築一戸建て販売件数

◆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