

# Central Daily Market Report

2016年10月3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3日		2016年10月4日		2016年10月5日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	1,100	800				0
財政	▲ 24,000	▲ 35,100				4,000
資金過不足	▲ 22,900	▲ 34,300				4,000
<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	▲ 4,500				
国債買現						
国庫短期証買入			17,500			
国債買入			7,900		8,900	
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	4,400		100		
当預増減	▲ 21,300		▲ 8,800			12,900
当座預金残高	3,097,100		3,088,300			3,101,200
準備預金残高	2,798,100					
積み終了先	2,329,000		10月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,329,000		積数	4,400		
非準備預金先	299,000		1日平均	400		
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額						2,075,500
準備預金進捗率	実績	99.79%	日数	60.00%		

## ●2016年10月3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1兆円増加の233兆8,000億円(当預金残高見込みは309兆6,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.07~▲0.065%、地銀・証券業態から▲0.06~▲0.03%の調達希望で始まった。四半期末を越えたことでレートが上昇し、朝方は▲0.06~▲0.055%近辺の出会いを中心に、▲0.03%程度までの範囲で出会いが見られた。一巡後も調達動向に大きな変化は無く、▲0.07~▲0.025%の幅広いレンジの出会いで推移した。ターム物は、四半期末要因が剥落し1W~1M物の期間で出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(10/4-10/5)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(10/5-10/6)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。前営業日からほぼ横ばいでの推移となった。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、5y127~128、10y340~343、20y155~158、30y49~52などにビットの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先S/N物は低位横ばい圏で推移。市場は材料なく閑散で、目立った出合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。五・十日に係る発行となったものの、鉄鋼業態からの大型発行案件が見られた程度で、償還総額800億円程度に対し、全体の発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの動きとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/10/3	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)	為替(17時)																																															
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.087	▲ 0.075	0.010	16,598.67	148.83	101.53-55	101.38-41																																																
T/N			▲ 0.055				-	▲ 0.087																																																						
S/N							-	-																																																						
1W	▲ 0.030	0.002	▲ 0.020				-	▲ 0.090																																																						
2W	▲ 0.030	0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.095																																																						
3W							-	▲ 0.099																																																						
1M	▲ 0.030	0.060	▲ 0.014				-	▲ 0.113																																																						
3M	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.013				▲ 0.399	▲ 0.166																																																						
6M							▲ 0.324	▲ 0.229																																																						
1Y							▲ 0.352	▲ 0.233																																																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>日付</th> <th>9/26</th> <th>9/27</th> <th>9/28</th> <th>9/29</th> <th>9/30</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>日銀当預残</td> <td>3,126,000</td> <td>3,125,500</td> <td>3,129,500</td> <td>3,122,800</td> <td>3,118,400</td> </tr> <tr> <td>準備預金残</td> <td>2,819,600</td> <td>2,818,300</td> <td>2,826,400</td> <td>2,815,100</td> <td>2,803,500</td> </tr> <tr> <td>マネタリーベース</td> <td>4,135,000</td> <td>4,134,500</td> <td>4,138,500</td> <td>4,132,600</td> <td>4,128,500</td> </tr> <tr> <td>無担O/N加重平均</td> <td>▲0.050%</td> <td>▲0.045%</td> <td>▲0.043%</td> <td>▲0.037%</td> <td>▲0.060%</td> </tr> <tr> <td>コール市場残高</td> <td>74,490</td> <td>78,269</td> <td>76,788</td> <td>78,982</td> <td>60,211</td> </tr> <tr> <td>うち無担</td> <td>53,617</td> <td>57,501</td> <td>56,536</td> <td>59,366</td> <td>50,438</td> </tr> <tr> <td>うち有担</td> <td>20,873</td> <td>20,768</td> <td>20,252</td> <td>19,616</td> <td>9,773</td> </tr> </tbody> </table>															日付	9/26	9/27	9/28	9/29	9/30	日銀当預残	3,126,000	3,125,500	3,129,500	3,122,800	3,118,400	準備預金残	2,819,600	2,818,300	2,826,400	2,815,100	2,803,500	マネタリーベース	4,135,000	4,134,500	4,138,500	4,132,600	4,128,500	無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.045%	▲0.043%	▲0.037%	▲0.060%	コール市場残高	74,490	78,269	76,788	78,982	60,211	うち無担	53,617	57,501	56,536	59,366	50,438	うち有担	20,873	20,768	20,252	19,616	9,773
日付	9/26	9/27	9/28	9/29	9/30																																																									
日銀当預残	3,126,000	3,125,500	3,129,500	3,122,800	3,118,400																																																									
準備預金残	2,819,600	2,818,300	2,826,400	2,815,100	2,803,500																																																									
マネタリーベース	4,135,000	4,134,500	4,138,500	4,132,600	4,128,500																																																									
無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.045%	▲0.043%	▲0.037%	▲0.060%																																																									
コール市場残高	74,490	78,269	76,788	78,982	60,211																																																									
うち無担	53,617	57,501	56,536	59,366	50,438																																																									
うち有担	20,873	20,768	20,252	19,616	9,773																																																									

## ●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	応募総額(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年以下)	700	2016/10/5			3,136	700	0.011		0.017	4.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/10/5			10,346	4,003	0.007		0.010	11.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/10/5			9,392	4,206	0.008		0.010	29.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	22,227	2016/10/3	2016/10/4		119	119		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年10月4日の予定

*9月のマネタリーベース	*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支	*10年利付国債入札(24,000億円、10/6発行)
*9月の消費動向調査		

◆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