Central Daily Market Report

2016年10月6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6日 需給速報		2016年10月7日 需給予想		2016年10月11日 当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 900		1,000	
財政	▲ 24,700		2,000		▲ 40,000	
資金過不足	▲ 25,400		1,100		▲ 39,000	
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			200	▲ 100	2,000	▲ 2,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 500	3,500	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			1,900			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 25,600		15,500		▲ 36,000	

当座預金残高	3,072,600	3,088,100	3,052,100
準備預金残高	2,769,000		
積み終了先	2,295,200	10月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,295,200	積数	2,600
非準備預金先	303,600	1日平均	300
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 99.87%	日数	70.00%

●2016年10月6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3兆4,000億円減少の229兆1,000億円(当座預金残高見込みは307兆2,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀勢を中心に▲0.03～▲0.02%近辺の調達希望で始まった。調達意欲は旺盛で、立ち上がりから徐々に取り上がり、▲0.01%が出合いの中心となった。一巡後も同様で▲0.03～▲0.01%の出合いが見られた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/7-10/11)は、▲0.085～▲0.08%程度の出合い。S/N(10/11-10/12)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。S/Nは短国発行等の要因から、レートが上昇した。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、5y127～129、10y340～343、20y155～158、30y49～52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物は低位横ばいで推移。短国市場は、3M物の入札が実施された。WI取引で3M▲0.35～▲0.345%での出合いが見られたが、入札結果は平均落札利回▲0.3274%・按分落札利回▲0.312%と、小甘い結果であった。セカンダリーでは3M▲0.32～▲0.315%と、入札結果を反映した出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、一部大型の発行案件が見られたものの、入札ベースの償還総額700億円程度に対し、全体の発行総額は800億円程度と同水準にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/6	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.084
T/N	▲ 0.042	▲ 0.005	▲ 0.012				－	▲ 0.083
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.007				－	▲ 0.092
2W							－	▲ 0.095
3W							－	▲ 0.100
1M							－	▲ 0.108
3M							▲ 0.320	▲ 0.163
6M							▲ 0.418	▲ 0.229
1Y							▲ 0.352	▲ 0.233

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）
▲ 0.065	0.000	16,899.10	79.86	103.44-46	103.68-70

日付		9/29	9/30	10/3	10/4	10/5
日銀当預残		3,122,800	3,118,400	3,097,100	3,088,300	3,098,200
準備預金残		2,815,100	2,803,500	2,798,100	2,773,700	2,779,200
マネタリーベース		4,132,600	4,128,500	4,106,100	4,096,500	4,106,400
無担O/N加重平均		▲0.037%	▲0.060%	▲0.044%	▲0.036%	▲0.030%
コール市場残高		78,982	60,211	74,048	85,836	89,903
	うち無担	59,366	50,438	52,953	65,242	69,319
	うち有担	19,616	9,773	21,095	20,594	20,584

●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)
国庫短期証券	638		43,800	2016/10/11	2017/1/16	159,854.0	39,923.8	100.0830	▲0.3120%	72.4444%	100.0871	▲0.3274%	3,876.0
10年物価連動債	21	0.10%	4,000	2016/10/11	2026/3/10	12,826.0	3,999.00	104.8000	▲0.3910%	40.0537%			

●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	2016/10/11	2016/10/24		2,010	2,010				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	28,153	2016/10/6	2016/10/7		98	98		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月7日の予定

*8月の毎月勤労統計調査速報
*8月の景気動向指数速報
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国8月の卸売売上高
*米国8月の消費者信用残高
*米国9月の雇用統計
*エネルギー対策借入
（5,500億円、10/20借入）

◆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