Central Daily Market Report

2016年10月11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11日 需給速報		2016年10月12日 需給予想		2016年10月13日 当社予想	
銀行券	900		1,100		0	
財政	▲ 38,900		▲ 2,500		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 38,000		▲ 1,400		▲ 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	2,000	▲ 2,500				
国債買現						
国庫短期証買入			30,100			
国債買入			7,400			
CP等買入	3,500	▲ 300		▲ 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	200					
国債補完供給	▲ 200	400		200		
当預増減	▲ 34,900		35,800		▲ 1,000	

当座預金残高	3,054,800	3,090,600	3,089,600
準備預金残高	2,760,400		
積み終了先	2,290,600		
超過準備	2,290,600		
非準備預金先	294,400		

10月12日以降の残り所要積立額	
積数	300
1日平均	100

積み期間（9/16～10/15）の所要準備額			2,088,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	86.67%

●2016年10月11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1兆6,000億円減少の228兆6,000億円(当座預金残高見込みは305兆3,000億円)。本日の無担O/Nは国内勢より▲0.045～▲0.02%の調達希望で始まった。積み最終を控えて調達意欲が一服した模様で、先週末対比でレートは低下し、立ち上がりは▲0.04～▲0.02%の出合い。一巡後もほぼ同水準の出合いで本日の取引を終えた。ターム物は証券業態のロール案件が見られた程度で閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(10/12-10/13)は、▲0.075～▲0.07%程度の出合い。S/N(10/13-10/14)は、▲0.075～▲0.07%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2Y366～367、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は低位横ばい圏で推移。市場に目立った材料は無く、閑散。特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額200億円強に対して、発行総額は100億円強と若干の償還超。案件数も少なく、閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2016/10/11	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	▲ 0.028				－	▲ 0.081
T/N							－	▲ 0.075
S/N							－	－
1W			▲ 0.025				－	▲ 0.087
2W							－	▲ 0.093
3W							－	▲ 0.098
1M							－	▲ 0.105
3M							▲ 0.313	▲ 0.163
6M							▲ 0.411	▲ 0.229
1Y							▲ 0.351	▲ 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）
▲ 0.055	0.015	17,024.76	164.67	103.69-72	103.92-94

日付		10/3	10/4	10/5	10/6	10/7
日銀当預残		3,097,100	3,088,300	3,098,200	3,072,600	3,089,700
準備預金残		2,798,100	2,773,700	2,779,200	2,769,000	2,776,700
マネタリーベース		4,106,100	4,096,500	4,106,400	4,081,600	4,099,500
無担O/N加重平均		▲0.044%	▲0.036%	▲0.030%	▲0.020%	▲0.018%
コール市場残高		74,048	85,836	89,903	89,228	88,463
	うち無担	52,953	65,242	69,319	69,005	68,710
	うち有担	21,095	20,594	20,584	20,223	19,753

●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Ⅰ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）	30,000	2016/10/11	2016/10/12		192	192		▲0.500	▲0.500	

●2016年10月12日の予定

*長野県金融経済懇談会にて原田審議委員講演
*8月の機械受注統計
*8月の特定サービス産業動態統計速報

◆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