

# Central Daily Market Report

2016年10月27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27日		2016年10月28日		2016年10月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 1,000		600	
財政	▲ 12,900		▲ 500		▲ 12,400	
資金過不足	▲ 14,600		▲ 1,500		▲ 11,800	
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					2,700	▲ 1,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 200	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						
E T F買入	700					
国債補充供給	▲ 100	400		100		
当預増減	▲ 13,800		10,100		▲ 7,500	
当座預金残高	3,160,700		3,170,800		3,163,300	
準備預金残高	2,848,200					
積み終了先	2,371,000					
超過準備	2,370,300					
非準備預金先	312,500					
			10月28日以降の残り所要積立額			
			積数		6,600	
			1日平均		300	
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	99.69%	日数	38.71%		

## ●2016年10月27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8,000億円減の237兆円(当座預金残高見込みは31兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.055~▲0.05%、地銀業態より▲0.055~▲0.035%での調達で始まった。一巡後も、散発的な出合いが続くなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/28-10/31)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(10/31-11/1)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは、月末等の要因から売り手の資金調達意欲が弱く、レートは低下した。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、2Y369のオファーが出難く、O/N中心に締まったレベルでの取引となった。

### <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3M物の入札は、WI取引で▲0.258%の出合いが小額見られる中、結果は按分レート▲0.2456%、平均レート▲0.2568%、按分比率12.6216%と、概ね事前の予想通りの結果だった。セカンダリーでは▲0.26~▲0.255%の出合いが小額見られた他、1Y物で▲0.305~▲0.30%の出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は償還総額7,000億円程度に対し、発行総額7,200億円程度だった。月末発行にあたり、商社、機械、鉄鋼、不動産、リース等、幅広い業種で大型の発行案件が見られた。発行総額は償還総額を上回ったものの、ディーラー、投資家の買い意欲はしっかりしており、発行レートは概ね横ばい圏だった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/10/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	東京 レポレート 平均値	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	▲0.065	0.001	▲0.044				-	▲0.087	▲0.060	0.009	17,336.42	▲55.42	104.56-58	104.61-62		
T/N	▲0.030	▲0.010	▲0.016				-	▲0.089								
S/N							-	-								
1W	▲0.036	▲0.015	▲0.028				-	▲0.093								
2W			0.000				-	▲0.095								
3W							-	▲0.099								
1M							-	▲0.102								
3M							▲0.258	▲0.154								
6M							▲0.302	▲0.225								
1Y							▲0.293	▲0.232								
											日付	10/20	10/21	10/24	10/25	10/26
											日銀当預残	3,129,400	3,141,200	3,134,700	3,175,000	3,174,500
											準備預金残	2,804,300	2,826,500	2,815,300	2,860,400	2,859,500
											マネタリーベース	4,139,800	4,153,300	4,147,400	4,188,200	4,189,000
											無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.035%	▲0.040%	▲0.041%	▲0.042%
											コール市場残高	79,452	78,682	77,273	83,540	84,059
											うち無担	60,275	59,781	58,495	64,558	65,577
											うち有担	19,177	18,901	18,778	18,982	18,482

## ●入札結果

名称	回数	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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	642	-	43,800	2016/10/31	2017/2/6	149,483.0	39,819.7	100.0660	▲0.2456%	12.6216%	100.0690	▲0.2568%	3,980.0
2年利付国債	370	0.10%	23,000	2016/11/15	2018/11/15	91,888.0	20,845.00	100.6750	▲0.2350%	89.7245%	100.6790	▲0.2370%	2,148.0

## ●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	2016/10/31	2016/11/14		2,660	2,660				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	38,680	2016/10/27	2016/10/28		48	48		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年10月28日の予定

*9月の完全失業率(市場予想：3.1%)	*9月の有効求人倍率(市場予想：1.37倍)	*米国7-9月期のGDP速報値
*9月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲3.0%)		
*9月全国・10月都区部消費者物価指数(CPI)		
市場予想：全 国(9月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.5%		
市場予想：東京都区部(10月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.5%		

◆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お客様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