

# Central Daily Market Report

2016年10月28日(金)

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28日		2016年10月31日		2016年11月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		600		1,000	
財政	1,300		▲ 16,200		▲ 8,000	
資金過不足	300		▲ 15,600		▲ 7,000	
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			2,700	▲ 1,900		
国債買現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	11,700				5,100	
CP等買入		▲ 200	3,500	▲ 2,200		
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			500			
国債補完供給		100				
当預増減	11,900		▲ 13,000		8,100	
当座預金残高	3,172,600		3,159,600		3,167,700	
準備預金残高	2,860,300					
積み終了先	2,390,500				10月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,390,500				積数 5,600	
非準備預金先	312,300				1日平均 400	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					2,153,000	
準備預金進捗率	実績	99.74%	日数	48.39%		

## ●2016年10月28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2兆円増の239兆円(当座預金残高見込みは317兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.05~▲0.045%、地銀業態より▲0.05~▲0.035%での調達で始まった。週末要因により、昨日までと比べやや強めの展開で始まったものの、一巡後はビッド水準が低下し、▲0.055~▲0.045%で散発的な出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(10/31-11/1)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(11/1-11/2)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、短国買入オペ等の要因から売り手の資金調達意欲が弱く、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、2年債のカレント近辺の銘柄にビッドの出入りが多く見られた。

### <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では3M物で▲0.27~▲0.255%、1Y物で▲0.295%の出合いが見られた。短国買入オペは1兆円で通知され、按分利回較差▲0.009%、平均利回較差0.000%、按分比率72.6%と、堅調な結果であった。

### <CP市場>

CP市場は発行総額1,500億円程度で、商社、食品等の業態でまとまった発行案件が見られた。発行レートは、銘柄毎のばらつきがあったものの、引き続き0%近辺が中心だった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/10/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.087	▲ 0.050	0.010	17,446.41	109.99	105.22-24	105.26-28		
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.091								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.092								
2W							-	▲ 0.094								
3W							-	▲ 0.099								
1M							-	▲ 0.102								
3M							▲ 0.264	▲ 0.154								
6M							▲ 0.295	▲ 0.225								
1Y							▲ 0.293	▲ 0.232								
											日付	10/21	10/24	10/25	10/26	10/27
											日銀当預残	3,141,200	3,134,700	3,175,000	3,174,500	3,160,700
											準備預金残	2,826,500	2,815,300	2,860,400	2,859,500	2,848,200
											マネタリーベース	4,153,300	4,147,400	4,188,200	4,189,000	4,176,900
											無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.040%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%
											コール市場残高	78,682	77,273	83,540	84,059	85,376
											うち無担	59,781	58,495	64,558	65,577	66,084
											うち有担	18,901	18,778	18,982	18,482	19,292

## ●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1非価格競争入札(億円)
預保借入(再生)	-	-	860	2016/11/11	2017/11/10	5,030.0	860.00		0.0000%	29.8610%		0.0000%	

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2016/11/1			15,504	10,001	▲0.009		0.000	72.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/11/1			13,147	4,106	0.011		0.012	80.2
国債買入(変動利付債)	1,000	2016/11/1			3,635	1,005	▲0.010		▲0.056	36.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2016/10/28	2016/10/31		38	38		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年10月31日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、11/1まで)  
\*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+1.0%)

\*9月の商業動態統計速報  
\*9月の住宅着工統計

\*米国9月の個人所得・消費支出  
\*米国10月のシカゴPM景況感指数  
\*ユーロ圏7-9月期のGDP1次速報値  
\*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値

◆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