

# Central Daily Market Report

2016年10月31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31日		2016年11月1日		2016年11月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 15,700		▲ 700		4,000	
資金過不足	▲ 15,200		▲ 800		3,000	
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			5,300		11,200	
CP等買入	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						
E T F買入	500					
国債補完供給	▲ 400			400		
当預増減	▲ 13,000		14,900		14,200	
当座預金残高	3,159,600		3,174,500		3,188,700	
準備預金残高	2,839,800					
積み終了先	2,371,000		11月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,371,000		積数	5,300		
非準備預金先	319,800		1日平均	400		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					2,155,200	
準備預金進捗率	実績	99.75%	日数	51.61%		

## ●2016年10月31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、前営業日比1兆9,000億円減の237兆1,000億円(当座預金残高見込みは316兆円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.055~▲0.045%、地銀業態より▲0.055~▲0.035%での調達で始まった。月末要因から、調達を控える先も多く、出合い一巡後はビッド水準が▲0.06~▲0.055%に低下し、閑散とした状況のなか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(11/1-11/2)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(11/2-11/4)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、オファーサイドの資金調達ニーズが薄く、動意に乏しくなり、レートに動きも見られなかった。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引き続き多く見られたほか、超長期債30年債・40年債のカレント銘柄にもビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートT/Nは横ばい圏で推移。アウトライト市場は材料少なく閑散としており、3M物で▲0.275%の出合いがみられた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は発行案件に乏しく閑散で、発行総額は200億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばい圏での取引となった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/10/31	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.089	▲ 0.055	▲ 0.005	17,425.02	▲ 21.39	104.57-58	104.91-93
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.036	▲ 0.015	▲ 0.026				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.272	▲ 0.154						
6M							▲ 0.295	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.297	▲ 0.232						
									日付	10/24	10/25	10/26	10/27	10/28
									日銀当預残	3,134,700	3,175,000	3,174,500	3,160,700	3,172,600
									準備預金残	2,815,300	2,860,400	2,859,500	2,848,200	2,860,300
									マネタリーベース	4,147,400	4,188,200	4,189,000	4,176,900	4,189,900
									無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.041%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.043%
									コール市場残高	77,273	83,540	84,059	85,376	90,646
									うち無担	58,495	64,558	65,577	66,084	71,721
									うち有担	18,778	18,982	18,482	19,292	18,925

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/2			10,875	4,004	▲0.001		0.000	82.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/2			8,780	4,208	▲0.003		▲0.002	99.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/11/2			6,938	1,914	▲0.009		▲0.008	17.7
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/11/2			3,386	1,107	▲0.014		▲0.012	48.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	45,792	2016/10/31	2016/11/1		405	405		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/10/31	2016/11/1		6	6		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年11月1日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*米国FOMC(1日目)
*黒田日銀総裁、定例会見	*米国9月の建設支出
*経済・物価情勢の展望	*米国10月のISM製造業景況指数

◆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