Central Daily Market Report

2016年10月4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4日 需給速報		2016年10月5日 需給予想		2016年10月6日 当社予想	
銀行券	800		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 35,000		400		▲ 24,000	
資金過不足	▲ 34,200		300		▲ 25,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入	17,500					
国債買入	7,900		9,100			
CP等買入				▲ 300		
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						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 8,800		9,200		▲ 25,000	

当座預金残高	3,088,300	3,097,500	3,072,500
準備預金残高	2,773,700		
積み終了先	2,304,600	10月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,304,600	積数	3,900
非準備預金先	314,600	1日平均	400
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 99.81%	日数	63.33%

●2016年10月4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2兆8,000億円減少の231兆円(当預金残高見込みは308兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀業態から▲0.065～▲0.06%、地銀・信託・証券業態等から▲0.045～▲0.03%の調達希望で始まった。朝方は▲0.045～▲0.03%の出合いが中心。一巡後は▲0.065～▲0.025%の幅広いレンジで出合いが見られた。ターム物は、ロール案件の取引のほか、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/5-10/6)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(10/6-10/7)は、▲0.09～▲0.085%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、5y127～128、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物は低位横ばい圏で推移。市場は引続き材料なく閑散であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。鉄鋼・ノンバンク業態から大型の発行案件が見られ、入札ベースでの償還総額100億円程度に対し、全体の発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは発行残高の積み上がった銘柄で小幅ながら上昇する動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/10/4	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.036				－	▲ 0.085
T/N							－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.023				－	▲ 0.090
2W							－	▲ 0.095
3W			0.020				－	▲ 0.098
1M							－	▲ 0.112
3M							▲ 0.399	▲ 0.161
6M							▲ 0.324	▲ 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)
▲ 0.075	0.000	16,735.65	136.98	101.83-85	102.39-40

日付		9/27	9/28	9/29	9/30	10/3
日銀当預残		3,125,500	3,129,500	3,122,800	3,118,400	3,097,100
準備預金残		2,818,300	2,826,400	2,815,100	2,803,500	2,798,100
マネタリーベース		4,134,500	4,138,500	4,132,600	4,128,500	4,106,100
無担O/N加重平均		▲0.045%	▲0.043%	▲0.037%	▲0.060%	▲0.044%
コール市場残高		78,269	76,788	78,982	60,211	74,048
	うち無担	57,501	56,536	59,366	50,438	52,953
	うち有担	20,768	20,252	19,616	9,773	21,095

●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)
10年利付国債	344	0.10%	24,000	2016/10/6	2026/9/20	82,883.0	21,709.00	101.5700	▲0.0560%	42.8477%	101.5900	▲0.0580%	2,273.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	52,557	2016/10/4	2016/10/5		103	103		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/10/6	2016/10/14	0.9	420	420				

●2016年10月5日の予定

*10月の日銀当座預金増減要因見込み
*米国8月の貿易収支
*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国9月のISM製造業景況指数
*国庫短期証券（637回）入札
（6ヶ月、35,000億円、10/11発行）
*交付税特別会計借入
（10,500億円、10/14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