

# Central Daily Market Report

2016年9月1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9月1日		2016年9月2日		2016年9月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 200		1,000	
財政	▲ 10,600		▲ 13,600		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 10,600		▲ 13,800		▲ 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					1,700	▲ 1,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金(成)			4,700	▲ 3,600		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	100		100			
国債補充供給	▲ 200	2,000		200		
当増減	▲ 9,000		▲ 12,600		▲ 3,200	
当座預金残高	3,026,000		3,013,400		3,010,200	
準備預金残高	2,738,100					
積み終了先	2,275,800				9月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,275,800				積数	5,100
非準備預金先	287,900				1日平均	400
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						2,141,700
準備預金進捗率	実績	99.76%	日数	54.84%		

## ●2016年9月1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3,000億円増加の227兆4,000億円(当座預金残高見込みは302兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.025%での調達で始まった。一巡後も同水準の出合いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、ロール案件の出合いが見られる程度であった。固定金利方式による共通担保資金供給オペは8,000億円で2W物がオファーされた。1,660億円の応札(期落ち額1,891億円)があったものの、引き続き未達となった。

### <レポ市場>

GC T/N(9/2-9/5)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/5-9/6)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/Nは、短国発行等の要因があったものの、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>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.25%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2425%、按分落札利回▲0.2304%と堅調な結果となった。セカンダリーは引け際に▲0.265%で小額の出合いが見られた程度と小動きだった。その他、6M物で▲0.2775%の出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は償還総額600億円程度に対し、電機・鉄鋼業態から大型発行案件が見られたものの、発行件数は少なく、発行総額は1,100億円弱となった。発行レートは概ね横ばいながら、長めのターム物では引き続き底堅いニーズが見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2016/9/1	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.086		▲ 0.045	0.024				
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.088							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.088							
2W							-	▲ 0.090							
3W							-	▲ 0.094							
1M							-	▲ 0.103							
3M							▲ 0.257	▲ 0.136							
6M							▲ 0.254	▲ 0.224							
1Y							▲ 0.254	▲ 0.225							
										日付	8/25	8/26	8/29	8/30	8/31
										日銀当預残	3,016,400	3,027,800	3,007,100	3,023,300	3,035,000
										準備預金残	2,725,700	2,734,400	2,727,000	2,736,000	2,731,100
										マネタリーベース	4,026,000	4,038,500	4,018,000	4,033,800	4,045,300
										無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.046%	▲0.048%
										コール市場残高	76,280	75,763	72,646	77,313	75,047
										うち無担	56,532	56,447	53,635	58,489	55,750
										うち有担	19,748	19,316	19,011	18,824	19,297

## ●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)
国庫短期証券	630	-	44,400	2016/9/5	2016/12/5	155,723.6	40,519.2	100.0575	▲0.2304%	26.9783%	100.0605	▲0.2425%	3,880.0
10年利付国債	344	0.10%	24,000	2016/9/20	2026/9/20	81,267.0	21,735.0	101.4500	▲0.0440%	89.1314%	101.4700	▲0.0460%	2,242.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/9/9	2017/3/9	110,698.0	10,500.03	-	0.0010%	9.4854%	-	0.0010%	-

## ●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	2016/9/5	2016/9/20		1,660	1,660				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,746	2016/9/1	2016/9/2		205	205		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,737	2016/9/1	2016/9/2		15	15		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年9月2日の予定

- |                      |                     |
|----------------------|---------------------|
| *8月のマネタリーベース         | *米国7月の貿易収支          |
| *8月の消費動向調査           | *米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫 |
| *8月実績/9月見込み財政資金対民間収支 | *米国8月の雇用統計          |

◆本資料は信頼できるとさ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よう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。