

Central Daily Market Report

2016年9月2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9月2日 需給速報	2016年9月5日 需給予想	2016年9月6日 当社予想
銀行券	0	1,400	2,000
財政	▲ 14,800	▲ 9,500	3,000
資金過不足	▲ 14,800	▲ 8,100	5,000

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					7,500	
国債買入					12,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)	4,700	▲ 3,600		▲ 100		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	100					
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 13,800		▲ 8,600		25,000	

当座預金残高	3,012,200	3,003,600	3,028,600
準備預金残高	2,713,500		
積み終了先	2,253,800	9月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,253,700	積数	3,700
非準備預金先	298,700	1日平均	300

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 99.83% 日数 64.52%

●2016年9月2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1兆7,000億円減少の225兆7,000億円(当座預金残高見込みは301兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.03%での調達で始まった。一巡後もほぼ同水準で推移した。ターム物は、ロール案件を中心とした出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(9/5-9/6)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/6-9/7)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、短国買入オペ等の要因があったことから、レートは若干低下した。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、10年債343回にビッドの出入りが多く見られ、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短国買入オペが7,500億円でオファーされた。応札が13,570億円にとどまるなど、品薄なマーケットを反映し、平均利回較差▲0.008%、按分利回較差▲0.018%と強めの結果となった。前場に3M物で▲0.262~▲0.26%の出合い、オペ後は3M物で▲0.285%の出合いが少額見られた。

<CP市場>

発行市場は償還総額400億円程度に対し、電機・商社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600億円程度と閑散なマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/2	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)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.084	▲ 0.025	0.020	16,925.68	▲ 1.16	103.25-26	103.57-58
T/N	▲ 0.055	0.000	▲ 0.051				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.272	▲ 0.136						
6M							▲ 0.257	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.260	▲ 0.225						

日付	8/26	8/29	8/30	8/31	9/1
日銀当預残	3,027,800	3,007,100	3,023,300	3,035,000	3,026,000
準備預金残	2,734,400	2,727,000	2,736,000	2,731,100	2,738,100
マネタリーベース	4,038,500	4,018,000	4,033,800	4,045,300	4,036,300
無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.046%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.049%
コール市場残高	75,763	72,646	77,313	75,047	78,603
うち無担	56,447	53,635	58,489	55,750	59,645
うち有担	19,316	19,011	18,824	19,297	18,958

●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	棄分率	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
国庫短期証券買入	7,500	2016/9/6			13,570	7,501	▲0.018		▲0.008	50.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/9/6			9,269	4,002	▲0.006		▲0.001	26.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/9/6			9,178	4,206	0.011		0.013	65.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/9/6			8,289	4,303	0.017		0.021	44.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/9/2	2016/9/5		143	143		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,745	2016/9/2	2016/9/5		10	10		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月5日の予定

*黒田日銀総裁、きさらぎ会にて講演	*米国祝日(Labor Day)
*7月の毎月勤労統計調査速報	
*9月の日銀当座預金増減要因見込み	

◆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