

Central Daily Market Report

2016年9月5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9月5日		2016年9月6日		2016年9月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,400		1,000		1,000	
財政	▲9,200		3,400		1,000	
資金過不足	▲7,800		4,400		2,000	
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			12,700			
CP等買入		▲300		▲200		
貸出支援基金(成)		▲100				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲100				
E T F買入			200			
国債補完供給	▲300	200		300		
当増減	▲8,600		24,900		2,000	
当座預金残高	3,003,600		3,028,500		3,030,500	
準備預金残高	2,712,700					
積み終了先	2,254,400					
超過準備	2,254,400					
非準備預金先	290,900					
		9月6日以降の残り所要積立額				
		積数		3,400		
		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	99.84%	日数	67.74%	

●2016年9月5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1兆4,000億円減少の224兆3,000億円(当座預金残高見込みは300兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態を中心に▲0.06~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後もほぼ水準で推移し、午後に入ると調整の調達が散見される中、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件を中心にショートタームでの出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(9/6-9/7)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/7-9/8)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。SCは5Y124~128、10Y336~343、20Y152~157、30Y49~51等カレント近辺を中心に新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。

<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。短国アウトライク市場は、イベントが無く閑散で、目立った出合いは聞かれなかった。

<CP市場>

CP市場は償還総額、発行総額ともに150億円程度であった。閑散な発行市場となる中、発行レートは横ばい圏で、特段動きは見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/5	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	▲0.045				-	▲0.085	▲0.025	0.000	17,037.63	111.95	103.92-94	103.35-38
T/N	▲0.055	0.000	▲0.042				-	▲0.088						
S/N							-	-						
1W	▲0.025	▲0.001	▲0.013				-	▲0.089						
2W	▲0.025	0.000	▲0.008				-	▲0.090						
3W							-	▲0.095						
1M			0.004				-	▲0.106						
3M							▲0.274	▲0.138						
6M							▲0.259	▲0.224						
1Y							▲0.260	▲0.225						
		日付		8/29	8/30	8/31	9/1	9/2						
日銀当預残		3,007,100		3,023,300	3,035,000	3,026,000	3,012,200							
準備預金残		2,727,000		2,736,000	2,731,100	2,738,100	2,713,500							
マネタリーベース		4,018,000		4,033,800	4,045,300	4,036,300	4,022,600							
無担O/N加重平均		▲0.046%		▲0.046%	▲0.048%	▲0.049%	▲0.047%							
コール市場残高		72,646		77,313	75,047	78,603	79,707							
うち無担		53,635		58,489	55,750	59,645	60,460							
うち有担		19,011		18,824	19,297	18,958	19,247							

●入札結果

名称	回数	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	応募総額(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)	62,745	2016/9/5	2016/9/6		219	219		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,655	2016/9/5	2016/9/6		53	53		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月6日の予定

*米国8月のISM製造業景況指数	*ユーロ圏4-6月期のGDP確報値	*30年利付国債入札(8,000億円、9/20発行)
*米国8月のFRB労働市場情勢指数		

◆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