Central Daily Market Report

2016年9月6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9月6日 需給速報		2016年9月7日 需給予想		2016年9月8日 当社予想	
銀行券	1,000		600		0	
財政	3,800		700		▲ 2,000	
資金過不足	4,800		1,300		▲ 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						
国債買現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入	12,700					
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
ＥＴＦ買入	200		400			
国債補完供給	▲ 400	300		400		
当預増減	24,900		1,900		▲ 2,000	

当座預金残高	3,028,500	3,030,400	3,028,400
準備預金残高	2,725,200		
積み終了先	2,268,500	9月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,268,500	積数	3,100
非準備預金先	303,300	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 99.86%	日数	70.97%

●2016年9月6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2兆3,000億円増加の226兆6,000億円(当座預金残高見込みは302兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.06～▲0.025%近辺での調達で始まった。一巡後もほぼ同水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物は、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(9/7-9/8)は、▲0.095～▲0.09%程度の出合い。S/N(9/8-9/9)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。短国アウトライト市場は、3M物で▲0.29～▲0.285%の出合いが見られたものの、総じて閑散であった。

<CP市場>
CP市場は償還総額900億円程度に対し、発行総額は400億円程度で、石油業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは銘柄毎のばらつきが見られたものの、概ね横ばい圏だった。CP等買入オペは事前の予定から変わらず5,000億円で通知され、按分レート▲0.002%、平均レート▲0.001%、按分比率36.4%という結果となった。通知額の増加を反映し、按分レートが前回比で若干低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/9/6	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.046				－	▲ 0.087
T/N			▲ 0.055				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W	▲ 0.001	0.002	0.001				－	▲ 0.090
2W							－	▲ 0.091
3W							－	▲ 0.096
1M							－	▲ 0.110
3M							▲ 0.276	▲ 0.141
6M							▲ 0.259	▲ 0.224
1Y							▲ 0.260	▲ 0.225

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）
▲ 0.025	0.000	17,081.98	44.35	103.50-53	103.35-36

日付		8/30	8/31	9/1	9/2	9/5
日銀当預残		3,023,300	3,035,000	3,026,000	3,012,200	3,003,600
準備預金残		2,736,000	2,731,100	2,738,100	2,713,500	2,712,700
マネタリーベース		4,033,800	4,045,300	4,036,300	4,022,600	4,012,600
無担O/N加重平均		▲0.046%	▲0.048%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.045%
コール市場残高		77,313	75,047	78,603	79,707	79,434
	うち無担	58,489	55,750	59,645	60,460	59,626
	うち有担	18,824	19,297	18,958	19,247	19,808

●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)
30年利付国債	52	0.50%	8,000	2016/9/20	2046/9/20	22,716.0	7,253.0	99.8000	0.5070%	8.5616%	99.9800	0.5000%	742.0

●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
CP等買入	5,000	2016/9/9			8,357	4,990	▲0.002		▲0.001	36.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	73,283	2016/9/6	2016/9/7		356	356		▲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	2016/9/6	2016/9/7		27	27		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月7日の予定

*7月の景気動向指数速報
*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国ベージュブック
*国庫短期証券（631回）入札
（6ヶ月、35,000億円、9/12発行）

◆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