Central Daily Market Report

2016年9月7日（水）
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7日 需給速報		2016年9月8日 需給予想		2016年9月9日 当社予想	
銀行券	600		200		1,000	
財政	300		600		1,000	
資金過不足	900		800		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						
国債買入					7,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 100	5,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入	400					
国債補完供給	▲ 300	400		300		
当預増減	1,200		900		14,500	

当座預金残高	3,029,700	3,030,600	3,045,100
準備預金残高	2,724,200		
積み終了先	2,270,300	9月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,270,300	積数	2,700
非準備預金先	305,500	1日平均	300
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			2,149,000
準備預金進捗率	実績 99.87%	日数	74.19%

●2016年9月7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7,000億円増加の227兆3,000億円(当座預金残高見込みは303兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.058～▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後は▲0.065～▲0.03%での出合いで推移し、本日の取引を終えた。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(9/8-9/9)は、▲0.095～▲0.09%程度の出合い。S/N(9/9-9/12)は、▲0.10～▲0.095%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。個別銘柄では特に10Y341、343にビッドが多く見られた。

<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%の出合いが見られた。6M物の入札は、按分レート▲0.2566%、平均レート▲0.2769%、按分比率28.4134%と、概ね事前の予想通りの結果となり、セカンダリーでは▲0.29～▲0.2769%で小額の出合いがあった。

<CP市場>

CP市場は償還総額900億円程度に対し、発行総額は1,100億円程度で、機械、商社、不動産等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは、引き続き銘柄毎のばらつきはあるものの、概ね0%近辺で順調な発行となった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/7	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.047				－	▲ 0.091
T/N			▲ 0.055				－	▲ 0.095
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.024				－	▲ 0.090
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.010				－	▲ 0.093
3W							－	▲ 0.097
1M							－	▲ 0.115
3M							▲ 0.276	▲ 0.141
6M							▲ 0.285	▲ 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)
▲ 0.060	▲ 0.035	17,012.44	▲ 69.54	101.58-60	101.54-56

日付	8/31	9/1	9/2	9/5	9/6
日銀当預残	3,035,000	3,026,000	3,012,200	3,003,600	3,028,500
準備預金残	2,731,100	2,738,100	2,713,500	2,712,700	2,725,200
マネタリーベース	4,045,300	4,036,300	4,022,600	4,012,600	4,036,500
無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%
コール市場残高	75,047	78,603	79,707	79,434	82,926
うち無担	55,750	59,645	60,460	59,626	63,983
うち有担	19,297	18,958	19,247	19,808	18,943

●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)
国庫短期証券	631	－	35,000	2016/9/12	2017/3/10	121,679.0	31,730.7	100.1260	**▲0.2566%**	**28.4134%**	100.1360	**▲0.2769%**	3,269.0

●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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2016/9/9			8,675	4,309	▲0.015		▲0.012	22.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,000	2016/9/9			4,613	2,003	▲0.003		0.002	28.9
国債買入（残存期間25年超）	1,200	2016/9/9			2,887	1,202	▲0.028		▲0.017	50.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	40,000	2016/9/7	2016/9/8		301	301		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/9/9	2016/9/15	0.9	1	1				

●2016年9月8日の予定

*中曽日銀副総裁、
在日米国商工会議所にて講演
*4-6月期のGDP2次速報
（市場予想：前期比年率0.0%）
*7月の国際収支
*7月の特定サービス産業動態統計速報
*8月の景気ウォッチャー調査
*ECB定例理事会（金融政策発表）
*米国7月の消費者信用残高
*国庫短期証券（632回）入札
（3ヶ月、44,000億円、9/12発行）
*5年利付国債入札
（24,000億円、9/20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