

Central Daily Market Report

2016年9月8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8日		2016年9月9日		2016年9月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		300		1,000	
財政	500		400		▲ 20,000	
資金過不足	800		700		▲ 19,000	
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					2,000	▲ 1,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 100	5,000	▲ 500		
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		▲ 200		
E T F買入			700			
国債補充供給	▲ 300	300		300		
当預増減	600		14,000		▲ 18,900	
当座預金残高	3,030,300		3,044,300		3,025,400	
準備預金残高	2,728,000					
積み終了先	2,272,800				9月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,272,800				積数	2,400
非準備預金先	302,300				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	99.89%	日数	77.42%		

●2016年9月8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3,000億円減少の227兆円(当座預金残高見込みは303兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後以降は▲0.065~▲0.035%での出合いが見られるなか、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(9/9~9/12)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/N(9/12~9/13)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。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3M物の入札は、WI取引で▲0.295~▲0.2875%と強めの出合いが見られる中、結果は按分レート▲0.2645%、平均レート▲0.2817%、按分比率12.2629%となり、良好な需給環境を背景に順調な入札となった。セカンダリーでは▲0.288~▲0.28%で小額の出合いがあった他、6M物で▲0.29%の出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP市場は償還総額1,300億円程度に対し、発行総額は1,600億円程度だった。五、十日発行にあたり、建設、小売、商社等の業態からからまとまった発行案件が見られた。引き続き発行レートに銘柄毎のばらつきが見られる中、9月末越え物を中心に積極的な応札姿勢が目立った。

●短期金融市場関連指標

2016/9/8	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	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				-	▲ 0.095	▲ 0.040	0.020	16,958.77	▲ 53.67	101.84-85	101.59-60
T/N	▲ 0.055	0.000	▲ 0.040				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.095						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.119						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.290	▲ 0.146						
6M							▲ 0.290	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.260	▲ 0.225						
									日付	9/1	9/2	9/5	9/6	9/7
									日銀当預残	3,026,000	3,012,200	3,003,600	3,028,500	3,029,700
									準備預金残	2,738,100	2,713,500	2,712,700	2,725,200	2,724,200
									マネタリーベース	4,036,300	4,022,600	4,012,600	4,036,500	4,037,100
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%
									コール市場残高	78,603	79,707	79,434	82,926	82,837
									うち無担	59,645	60,460	59,626	63,983	63,775
									うち有担	18,958	19,247	19,808	18,943	19,062

●入札結果

名称	回数	表面利率	発行予定額(億円)	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	632	-	43,800	2016/9/12	2016/12/12	152,175.0	39,703.5	100.0660	▲0.2645%	12.2629%	100.0703	▲0.2817%	4,096.0
5年利付国債	129	0.10%	24,000	2016/9/20	2021/9/20	66,072.0	21,782.00	101.3800	▲0.1730%	75.1430%	101.3900	▲0.1750%	2,210.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2016/9/12	2016/9/26		1,970	1,970				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,545	2016/9/8	2016/9/9		260	260		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月9日の予定

*7月の第3次産業活動指数
*8月のマネーストック
*マクロ加算残高にかかる基準比率

*米国7月の卸売売上高

*エネルギー対策借入(6,000億円、9/20借入)

◆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