Central Daily Market Report

2016年9月9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9日 需給速報		2016年9月12日 需給予想		2016年9月13日 当社予想	
銀行券	300		1,200		1,000	
財政	0		▲ 23,200		▲ 1,000	
資金過不足	300		▲ 22,000		0	
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					12,500	
国債買入	8,000				8,900	
CP等買入	5,000	▲ 500		▲ 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		▲ 200		▲ 100		
ＥＴＦ買入	700					
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	13,400		▲ 22,000		21,400	

当座預金残高	3,043,700	3,021,700	3,043,100
準備預金残高	2,735,300		
積み終了先	2,280,400		
超過準備	2,280,400		
非準備預金先	308,400		

9月12日以降の残り所要積立額	
積数	800
1日平均	200

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	99.96%	日数 87.10%

●2016年9月9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9,000億円増加の227兆9,000億円(当座預金残高見込みは304兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心として▲0.059～▲0.03%近辺での調達で始まり、一巡後は▲0.07～▲0.03%前後の出合い水準で推移した。午後は閑散としたまま本日の取引を終了した。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(9/12-9/13)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(9/13-9/14)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では3M物で▲0.30～▲0.297%、6M物で▲0.30%の出合いが見られた。短国買入オペは1兆2,500億円で通知され、按分利回較差▲0.006%、平均利回較差▲0.001%、按分比率36.5%と、需給の良さを反映した結果となった。

<CP市場>

CP市場は償還総額2,100億円程度に対し、発行総額は250億円程度だった。小売等の業態でまとまった発行案件が見られたが、9月末に向けた有利子負債削減の動きもあり、閑散なマーケットであった。引き続き、9月末越物で積極的な応札姿勢が見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/9/9	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	▲ 0.074	0.001	▲ 0.046				－	▲ 0.094
T/N	▲ 0.060	0.000	▲ 0.048				－	▲ 0.091
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.030	▲ 0.008				－	▲ 0.097
2W							－	▲ 0.099
3W							－	▲ 0.130
1M							－	▲ 0.136
3M							▲ 0.298	▲ 0.147
6M							▲ 0.297	▲ 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）
▲ 0.019	0.021	16,965.76	6.99	102.31-33	102.20-22

日付		9/2	9/5	9/6	9/7	9/8
日銀当預残		3,012,200	3,003,600	3,028,500	3,029,700	3,030,300
準備預金残		2,713,500	2,712,700	2,725,200	2,724,200	2,728,000
マネタリーベース		4,022,600	4,012,600	4,036,500	4,037,100	4,037,400
無担O/N加重平均		▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%
コール市場残高		79,707	79,434	82,926	82,837	83,162
	うち無担	60,460	59,626	63,983	63,775	64,749
	うち有担	19,247	19,808	18,943	19,062	18,413

●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)
エネルギー対策	－	－	6,000	2016/9/20	2017/9/20	39,046.0	5,999.99		0.0010%	15.3666%		0.0010%	

●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	12,500	2016/9/13			25,206	12,502	▲0.006		▲0.001	36.5
国債買入（残存期間1年以下）	700	2016/9/13			1,651	700	▲0.015		0.080	13.7
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2016/9/13			6,550	4,000	▲0.018		▲0.009	92.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2016/9/13			8,822	4,206	0.002		0.005	51.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	30,000	2016/9/9	2016/9/12		150	150		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	1,938	2016/9/9	2016/9/12		3	3		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月12日の予定

*7月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲3.5%）

*8月の企業物価指数

◆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