Central Daily Market Report

2016年9月12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12日 需給速報		2016年9月13日 需給予想		2016年9月14日 当社予想	
銀行券	1,100		300		0	
財政	▲ 23,800		800		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 22,700		1,100		▲ 6,000	
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			12,500			
国債買入			9,000		4,600	
CP等買入		▲ 200		▲ 700		
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						
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	▲ 23,100		22,300		▲ 1,400	

当座預金残高	3,020,600	3,042,900	3,041,500
準備預金残高	2,722,800		
積み終了先	2,268,700		
超過準備	2,268,400		
非準備預金先	297,800		

9月13日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	100

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	99.99%	日数	90.32%

●2016年9月12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5,000億円減少の227兆4,000億円(当座預金残高見込みは302兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.065～▲0.03%の調達で始まった。一巡後は▲0.075～▲0.03%近辺での出合いで推移し、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(9/13-9/14)は、▲0.125～▲0.095%程度の出合い。S/N（9/14-9/15）は、▲0.35～▲0.11%程度の出合い。S/Nは投資家のオファーニーズが大きく減退したことでオファーサイドが薄くなり、担保玉確保を目的とした業者のビッドによってレートを大きく下げながらの推移となった。SCはGCレートが大きく目線を切り下げながらの推移となったことで殆どの銘柄がタイトなレートでの推移となった。個別銘柄では2y366～367、5y128、10y340～343、20y154～157、30y49～51、40y9などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先T/Nは前日より低下。アウトライト市場は品薄感が強く閑散とした中、3Mで▲0.325～▲0.320%、6Mで▲0.315～▲0.300%の出合いが小額みられた程度であった。

<CP市場>

CP市場は発行件数、発行額ともに少なく、閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/12	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.049				－	▲ 0.101
T/N	▲ 0.055	0.000	▲ 0.042				－	▲ 0.110
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.015				－	▲ 0.101
2W			▲ 0.030				－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.137
1M							－	▲ 0.144
3M							▲ 0.315	▲ 0.150
6M							▲ 0.309	▲ 0.225
1Y							▲ 0.260	▲ 0.226

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	0.000	16,672.92	292.84	102.46-48	102.31-32

日付		9/5	9/6	9/7	9/8	9/9
日銀当預残		3,003,600	3,028,500	3,029,700	3,030,300	3,043,700
準備預金残		2,712,700	2,725,200	2,724,200	2,728,000	2,735,300
マネタリーベース		4,012,600	4,036,500	4,037,100	4,037,400	4,050,500
無担O/N加重平均		▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.046%
コール市場残高		79,434	82,926	82,837	83,162	87,444
	うち無担	59,626	63,983	63,775	64,749	68,717
	うち有担	19,808	18,943	19,062	18,413	18,727

●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）	応募額（億円）	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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	2016/9/14			8,476	4,302	▲0.023		▲0.019	92.4
国債買入（物価連動債）	250	2016/9/14			1,297	251	▲0.350		▲0.527	28.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	83,339	2016/9/12	2016/9/13		277	277		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	16,374	2016/9/12	2016/9/13		127	127		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月13日の予定

*7月のマネタリーサーベイ
*7-9月期の法人企業景気予測調査季報
*8月の米財政収支
*8月の英消費者物価指数
*20年利付国債入札
（11,000億円、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