

Central Daily Market Report

2016年9月13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13日		2016年9月14日		2016年9月15日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	400	▲ 200	▲ 200	▲ 1,000		
財政	▲ 1,600	▲ 4,300	▲ 4,300	▲ 13,000		
資金過不足	▲ 1,200	▲ 4,500	▲ 4,500	▲ 14,000		
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	12,500					
国債買入	9,000		4,700			
CP等買入		▲ 700		▲ 300		
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	▲ 200	400		200		
当預増減	19,800		0		▲ 14,000	
当座預金残高	3,040,400		3,040,400		3,026,400	
準備預金残高	2,738,700					
積み終了先	2,284,200		9月14日以降の残り所要積立額		積数 0	
超過準備	2,284,000		1日平均		0	
非準備預金先	301,700					
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	100.00%	日数	93.55%		

●2016年9月13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3,000億円増加の227兆7,000億円(当座預金残高見込みは304兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.08~▲0.03%近辺での調達で始まった。全体的な調達意欲は昨日よりもやや弱く、一巡後は▲0.085~▲0.03%での出会いで推移し、午後に入ると調整の調達が散見される中、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件を中心にショートタームでの出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(9/14-9/15)は、▲0.12~▲0.095%程度のお合い。S/N(9/15-9/16)は、▲0.18~▲0.12%程度のお合い。T/Nは、昨日は非常にタイトなレートで推移したものの、業者のビッドニーズが落ち着いたことでレートは上昇基調となり、出会いのレンジも限られたものとなった。S/Nも、取引開始直後はオファービッドの目線が大きく乖離したものの、ビッドサイドの入りから、オファーサイドが寄せる形で出会いをつけ、レートは上昇しながらの推移となった。SCIはGCレートが落ちて着いて推移したことで、レート水準を大きく戻しタイトなレートで取引される銘柄数も限られたものとなった。個別銘柄では2y366~367、5y127~128、10y340~343、20y155~157、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は低水準で推移。アウトライト市場は品薄感が強く閑散とした中、3Mで▲0.335~▲0.329%のお合いがみられた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、五・十日に係る発行となり一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は2,500億円程度と、償還総額2,600億円程度に対して同水準の発行にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。CP等買入オペがオファー額5,000億円を実施され、入札結果は平均落札利回▲0.009%、按分落札利回▲0.038%と、前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/9/13	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.102	▲ 0.020	▲ 0.001	16,729.04	56.12	101.73-75	101.81-83
T/N			▲ 0.065				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W			0.050				-	▲ 0.113						
2W							-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.142						
1M							-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.328	▲ 0.155						
6M							▲ 0.320	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.260	▲ 0.226						
									日付	9/6	9/7	9/8	9/9	9/12
									日銀当預残	3,028,500	3,029,700	3,030,300	3,043,700	3,020,600
									準備預金残	2,725,200	2,724,200	2,728,000	2,735,300	2,722,800
									マネタリーベース	4,036,500	4,037,100	4,037,400	4,050,500	4,026,300
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.049%
									コール市場残高	82,926	82,837	83,162	87,444	76,637
									うち無担	63,983	63,775	64,749	68,717	58,094
									うち有担	18,943	19,062	18,413	18,727	18,543

●入札結果

名称	回数	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	素分率	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)
20年利付国債	158	0.50%	11,000	2016/9/20	2036/9/20	33,223.0	9,969.0	101.0500	0.4420%	82.4367%	101.1500	0.4370%	1,021.0

●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	2016/9/16			8,599	4,998	▲0.038		▲0.009	55.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,369	2016/9/13	2016/9/14		172	172		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	11,566	2016/9/13	2016/9/14		48	48		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/9/15	2016/9/23	0.9	2	2				

●2016年9月14日の予定

*国庫短期証券(633回)入札
(1年、25,000億円、9/20発行)

◆本資料は信頼できるとさ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お客様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