

Central Daily Market Report

2016年9月15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15日		2016年9月16日		2016年9月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 1,600		▲ 1,000	
財政	▲ 11,700		1,800		43,000	
資金過不足	▲ 12,800		200		42,000	
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					4,500	▲ 1,700
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,600			
CP等買入		▲ 1,000	5,000	▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			54,400	▲ 29,400		
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入			800			
国債補完供給	▲ 800	3,600		800		
当預増減	▲ 11,100		42,900		44,800	
当座預金残高	3,025,800		3,068,700		3,113,500	
準備預金残高	2,722,900					
積み終了先	2,273,800					
超過準備	2,273,800					
非準備預金先	302,900					
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,072,900	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2016年9月15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2,000億円減少の227兆円(当座預金残高見込みは302兆7,000億円)。積みの最終日となる本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.085~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後も同水準の出合いで推移し、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。固定金利方式による共通担保資金供給オペは8,000億円オファーされた。4,540億円の落札で引き続き未達となったものの、期落ち額1,660億円に対し、大幅な増加となった。

<レポ市場>

GC T/N(9/16-9/20)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/20-9/21)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/Nは国債の大量発行日の要因からオファーサイドのニーズが厚くなり、レート水準をやや上げて推移することとなった。SCはロールオーバーを中心に引合いが行われた。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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.38~▲0.37%と事前予想より強めの出合いが見られたことから、結果は平均落札利回▲0.3549%、按分落札利回▲0.3363%(按分比率14.9302%)と、3M物としては2ヶ月振りに過去最低レートを更新した。セカンダリーは▲0.378~▲0.36%と堅調に推移した。また、1Y物で▲0.385~▲0.365%の出合いがみられた。

<CP市場>

CP市場は、鉄鋼業態等からまとまった発行があり、発行総額1,500億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/9/15	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.096	▲ 0.045	▲ 0.025	16,405.01	▲ 209.23	102.55-57	102.44-46
T/N			▲ 0.065				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.003	▲ 0.026				-	▲ 0.102						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.131						
3W			0.030				-	▲ 0.140						
1M							-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.366	▲ 0.163						
6M							▲ 0.321	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.362	▲ 0.227						
									日付	9/8	9/9	9/12	9/13	9/14
									日銀当預残	3,030,300	3,043,700	3,020,600	3,040,400	3,036,900
									準備預金残	2,728,000	2,735,300	2,722,800	2,738,700	2,725,600
									マネタリーベース	4,037,400	4,050,500	4,026,300	4,045,700	4,042,500
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.046%	▲0.049%	▲0.057%	▲0.063%
									コール市場残高	83,162	87,444	76,637	76,824	77,674
									うち無担	64,749	68,717	58,094	57,511	57,337
									うち有担	18,413	18,727	18,543	19,313	20,337

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	634	-	44,000	2016/9/20	2016/12/19	166,149.0	39,927.7	100.0830	▲0.3363%	14.9302%	100.0876	▲0.3549%	4,072.0
流動性供給	221	-	2,000	2016/9/20	-	9,782.0	1,999.00		▲0.0260%	52.6314%		▲0.0330%	

●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	2016/9/20	2016/10/3		4,540	4,540				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	63,874	2016/9/15	2016/9/16		530	530		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	30,000	2016/9/15	2016/9/16		286	286		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第65回	2016/9/23	2017/9/22	0	808
被災地金融支援オペ(熊本)	第4回	2016/9/23	2017/9/22	0	2

●2016年9月16日の予定

*米国8月の消費者物価指数

*米国9月のミシガン大学消費者信頼感指数速報

◆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