

Central Daily Market Report

2016年9月16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16日		2016年9月20日		2016年9月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 200		▲ 2,000	
財政	600		33,200		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 1,000		33,000		▲ 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			4,500	▲ 1,700		
国債買現						
国庫短期証買入					12,500	
国債買入	11,600				8,900	
CP等買入	5,000	▲ 500		▲ 1,400		
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				▲ 400		
E T F買入	800		100			
国債補完供給	▲ 600	800		600		
当預増減	41,100		34,700		15,400	
当座預金残高	3,066,900		3,101,600		3,117,000	
準備預金残高	2,762,600					
積み終了先	2,288,300				9月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,807,400				積数	56,800
非準備預金先	304,300				1日平均	2,200
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	97.26%	日数	13.33%		

●2016年9月16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5兆円増加の232兆円(当座預金残高見込みは306兆9,000億円)。積み初日となる本日の無担O/Nは信託・地銀を中心に▲0.08~▲0.04%近辺の調達希望で始まった。マクロ加算残高の基準比率が10%に増加したものの、引き続き調達意欲は限定的で、立ち上がりは▲0.075~▲0.03%の出会い。一巡後は▲0.08~▲0.035%の出会いが散見された。ターム物は決定会合を控え、様子見閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(9/20-9/21)は、▲0.095~▲0.08%程度 of 出会い。S/N(9/21-9/23)は、▲0.095~▲0.085%程度 of 出会い。S/Nは日銀の国債・短国買入オペがオファーされたことから資金調達サイドのニーズが減退し、レートは若干低下基調となった。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>

現先レートT/Nは発行要因からやや上昇。短国買入オペが12,500億円でオファーされた。結果は、平均利回較差▲0.001%、按分利回較差▲0.016%(按分比率11.7%)と品薄感を反映した結果となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。ノンバンク業態から大型の発行案件が見られたものの、発行総額は1,100億円程度と、償還総額1,300億円程度に対し同水準の発行にとどまった。発行レートは、一部の月越え銘柄で買い進まれる動きが見られたが、概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.060				-	▲ 0.090	▲ 0.040	0.005	16,519.29	114.28	101.98-01	101.90-91
T/N			▲ 0.065				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.100						
2W							-	▲ 0.134						
3W							-	▲ 0.139						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.142						
3M							▲ 0.366	▲ 0.163						
6M							▲ 0.322	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.362	▲ 0.227						
									日付	9/9	9/12	9/13	9/14	9/15
									日銀当預残	3,043,700	3,020,600	3,040,400	3,036,900	3,025,800
									準備預金残	2,735,300	2,722,800	2,738,700	2,725,600	2,722,900
									マネタリーベース	4,050,500	4,026,300	4,045,700	4,042,500	4,032,500
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.049%	▲0.057%	▲0.063%	▲0.065%
									コール市場残高	87,444	76,637	76,824	77,674	77,879
									うち無担	68,717	58,094	57,511	57,337	58,540
									うち有担	18,727	18,543	19,313	20,337	19,339

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1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
国庫短期証券買入	12,500	2016/9/21			21,772	12,502	▲0.016		▲0.001	11.7
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/9/21			1,362	700	▲0.045		▲0.011	10.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/9/21			10,774	4,005	0.002		0.004	12.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/9/21			11,969	4,208	0.006		0.007	96.2
社債等買入	1,250	2016/9/26			2,371	1,250	▲0.215		▲0.171	24.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	109,629	2016/9/16	2016/9/20		625	625		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/9/16	2016/9/20		11	11		▲0.600	▲0.600	

●2016年9月20日の予定

*日銀金融政策委員会・金融政策決定会合(1日目、21日まで)	*米国FOMC(1日目) *米国8月の住宅着工件数	*国庫短期証券(635回)入札(3ヶ月、44,000億円、9/26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