

Central Daily Market Report

2016年9月27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27日		2016年9月28日		2016年9月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		0		▲ 1,000	
財政	▲ 8,200		▲ 9,400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 8,200		▲ 9,400		▲ 5,000	
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	7,500					
国債買入			13,000			
CP等買入		▲ 700		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	100		300			
国債補完供給	▲ 800	1,600		800		
当預増減	▲ 500		4,100		▲ 5,000	
当座預金残高	3,125,500		3,129,600		3,124,600	
準備預金残高	2,818,300					
積み終了先	2,344,900				9月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,344,900				積数	8,600
非準備預金先	307,200				1日平均	500
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	99.59%	日数	40.00%		

●2016年9月27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4,000億円増加の235兆2,000億円(当預金残高見込みは312兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、地銀・証券業態から▲0.060%~▲0.030%、都銀・信託業態から▲0.065%~▲0.060%の調達希望で始まった。一日を通してビッド水準に大きな変化は無く、▲0.065%~▲0.030%のレンジでの出会いが中心となった。ターム物は、閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(9/28-9/29)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。S/N(9/29-9/30)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。GCターム物では期越えの1Wでレートが低下する動きが見られた。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、30y49~52、40y9などにビッドの出入りが多く見られた。40y9はオープンとなったが引き続きニーズが見られた。

<短国市場>

現先レートS/Nは引き続き低位横ばい圏での推移となった。アウトライト市場は、前日に引き続き本日も売り物に乏しく、出合薄なマーケットとなった。

<CP市場>

現先レートS/Nは引き続き低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は、機械業態等から大型発行案件が見られ、1,500億円程度の規模となった。発行レートに目立った変動は見られなかった。また、CP等買入オファーが5,500億円オファーされ、平均落札利回▲0.032%、按分落札利回▲0.067%の結果となり、前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/9/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.083	▲ 0.080	▲ 0.016	16,683.93	139.37	100.38-40	100.53-54
T/N			0.000				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.010	0.003				-	▲ 0.176						
2W			0.000				-	▲ 0.141						
3W							-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.342	▲ 0.169						
6M							▲ 0.317	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.355	▲ 0.226						
									日付	9/16	9/20	9/21	9/23	9/26
									日銀当預残	3,066,900	3,096,200	3,119,000	3,121,800	3,126,000
									準備預金残	2,762,600	2,788,400	2,818,600	2,814,400	2,819,600
									マネタリーベース	4,075,200	4,104,900	4,128,600	4,131,700	4,135,000
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.060%	▲0.061%	▲0.054%	▲0.050%
									コール市場残高	75,052	70,748	72,540	73,065	74,490
									うち無担	55,001	51,149	52,639	53,108	53,617
									うち有担	20,051	19,599	19,901	19,957	20,873

●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)
40年利付国債	9	0.40%	5,000	2016/9/29	2056/3/20	13,633.0	4,994.00	94.3400	0.5600%	15.6657%			

●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	5,500	2016/9/30			11,357	5,500	▲0.067		▲0.032	80.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	103,907	2016/9/27	2016/9/28		800	800		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/9/29	2016/10/6	0.85	655	655				

●2016年9月28日の予定

*米国8月の耐久財新規受注

◆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