

Central Daily Market Report

2016年9月29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29日		2016年9月30日		2016年10月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 400		1,000	
財政	▲ 6,700		▲ 8,800		▲ 32,000	
資金過不足	▲ 7,500		▲ 9,200		▲ 31,000	
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					1,900	▲ 4,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,000			
CP等買入		▲ 700	5,500	▲ 7,800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	1,100		1,900			
国債補完供給	▲ 200	600		200		
当預増減	▲ 6,700		2,600		▲ 33,600	
当座預金残高	3,122,800		3,125,400		3,091,800	
準備預金残高	2,815,100					
積み終了先	2,347,000		9月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,347,000		積数		6,900	
非準備預金先	307,700		1日平均		400	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,073,200	
準備預金進捗率	実績	99.67%	日数	46.67%		

●2016年9月29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1兆1,000億円減少の234兆7,000億円(当預金残高見込みは312兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、地銀・証券業態から▲0.05~▲0.03%、都銀・信託業態から▲0.065~▲0.04%の調達希望で始まった。複数の先から強めのビッドが入ったため、レートは昨日対比で上昇し、朝方の出合いは▲0.045~▲0.03%が中心となった。一巡後もビッドは底堅く、▲0.05~▲0.02%のレンジの出合いで推移した。ターム物は、閑散な地合いであった。本日の固定金利方式による共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、落札額1,910億円(期落ち額4,540億円)の札割れであった。

<レポ市場>

GC T/N(9/30-10/3)は、▲0.40~▲0.25%程度の出合い。S/N(10/3-10/4)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。T/Nは、期末初にあたり引き続き資金調達サイドが薄く、買い進まれる展開となりレートは大きく低下した。S/Nは期末要因が剥落し、短国3Mの発行要因も加わったことでレートは上昇した。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。

<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。本日は3M入札が実施された。10月スタートの発行となったものの、品薄な地合いの中、平均落札利回り▲0.3547%、按分落札利回り▲0.3407%と引き続き強い結果となった。按分落札利回りは、3M物として過去最低を更新した。セカンダリーでは、▲0.38~▲0.37%での取引となった。

<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、2営業日後が10月月初にあたり、償還額は少ないものの、入札ベースで3,900億円程度の発行が見られた。鉄鋼、機械、ノンバンク業態等からは大型発行案件が見られた。発行レートに目立った変動は無く、0%近傍で張り付く展開であった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/29	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.084	▲ 0.090	0.005	16,693.71	228.31	100.94-96	101.52-53
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.336						
S/N							-	-						
1W			0.004				-	▲ 0.092						
2W			0.010				-	▲ 0.097						
3W			0.030				-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.378	▲ 0.170						
6M							▲ 0.317	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.353	▲ 0.233						
									日付	9/21	9/23	9/26	9/27	9/28
									日銀当預残	3,119,000	3,121,800	3,126,000	3,125,500	3,129,500
									準備預金残	2,818,600	2,814,400	2,819,600	2,818,300	2,826,400
									マネタリーベース	4,128,600	4,131,700	4,135,000	4,134,500	4,138,500
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.054%	▲0.050%	▲0.045%	▲0.043%
									コール市場残高	72,540	73,065	74,490	78,269	76,788
									うち無担	52,639	53,108	53,617	57,501	56,536
									うち有担	19,901	19,957	20,873	20,768	20,252

●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	636	-	44,300	2016/10/3	2017/1/10	128,243.0	40,549.7	100.0925	▲0.3407%	64.7142%	100.0963	▲0.3547%	3,750.0
2年利付国債	369	0.10%	23,000	2016/10/17	2018/10/15	79,279.0	20,975.00	100.7100	▲0.2540%	52.0684%	100.7280	▲0.2630%	2,022.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/10/3	2016/10/17		1,910	1,910				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,392	2016/9/29	2016/9/30		195	195		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	856	2016/9/29	2016/9/30		4	4		▲0.500	▲0.500	

●2016年9月30日の予定

*金融政策決定会合における主な意見(9月20、21日分)
 *8月完全失業率(市場予想：3.0%) *8月の有効求人倍率(市場予想：1.37倍)
 *8月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲2.5%)
 *8月全国・9月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想：全 国(8月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%
 ：東京都区部(9月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%
 *8月鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比0.5%)

*8月の住宅着工統計
 *米国8月の個人所得・消費支出
 *米国9月のシカゴPM景況感指数
 *ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値
 *英国4-6月期のGDP確報値

◆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