

Central Daily Market Report

2016年9月30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30日		2016年10月3日		2016年10月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		1,100		1,000	
財政	▲ 11,500		▲ 24,800		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 11,800		▲ 23,700		▲ 25,000	
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					17,500	
国債買入	12,000				7,300	
CP等買入	5,500	▲ 7,800		▲ 100		
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	1,900					
国債補完供給	▲ 4,400	200		4,400		
当預増減	▲ 4,400		▲ 22,000		▲ 200	
当座預金残高	3,118,400		3,096,400		3,096,200	
準備預金残高	2,803,500					
積み終了先	2,329,900		10月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,329,800		積数		5,000	
非準備預金先	314,900		1日平均		400	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					2,075,500	
準備預金進捗率	実績	99.76%	日数	56.67%		

●2016年9月30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1兆9,000億円減少の232兆8,000億円(当預金残高見込みは312兆5,000億円)。本日の無担O/N物は、四半期末要因で調達サイドの参加者が減少したため、各業態から▲0.08%近辺の調達希望で始まった。朝一番の出合いは▲0.075%近辺が中心となり、昨日対比でレートが低下した。出合い一巡後も複数の先からビッドが残ったことで、徐々に取り上がる展開となり、▲0.075~▲0.06%のレンジで出合いが見られた。ターム物は、閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(10/3-10/4)は、▲0.08~▲0.075%程度の出合い。S/N(10/4-10/5)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。国債・短国の買入オペが通知されたことで、S/Nは前日比若干の低下となった。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、30y49~52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。短国買入オペが17,500億円で実施され、平均落札利回較差▲0.008%、按分落札利回較差▲0.032%と品薄感を反映した強めの結果となった。アウトライト市場は▲0.41~0.40%と堅調な水準で取引が行われた。

<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発行市場は石油業態から大型案件が見られた程度で、件数も少なく、総じて閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/30	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.286	▲ 0.085	0.005	16,449.84	▲ 243.87	101.20-22	100.89-91
T/N			▲ 0.050				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.019				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.100						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.398	▲ 0.168						
6M							▲ 0.323	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.352	▲ 0.233						
									日付	9/23	9/26	9/27	9/28	9/29
									日銀当預残	3,121,800	3,126,000	3,125,500	3,129,500	3,122,800
									準備預金残	2,814,400	2,819,600	2,818,300	2,826,400	2,815,100
									マネタリーベース	4,131,700	4,135,000	4,134,500	4,138,500	4,132,600
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.050%	▲0.045%	▲0.043%	▲0.037%
									コール市場残高	73,065	74,490	78,269	76,788	78,982
									うち無担	53,108	53,617	57,501	56,536	59,366
									うち有担	19,957	20,873	20,768	20,252	19,616

●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	案分率	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	17,500	2016/10/4			25,625	17,503	▲0.032		▲0.008	11.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/10/4			11,040	4,104	0.014		0.016	85.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/10/4			6,842	2,000		0.007	0.008	
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/10/4			3,606	1,205	▲0.007		▲0.004	57.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	95,769	2016/9/30	2016/10/3		4,326	4,326		▲0.500	▲0.510	

●2016年10月3日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国8月の建設支出
	*米国9月のISM製造業景況指数

◆本資料は信頼できると思わ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