Central Daily Market Report

2016年9月23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23日 需給速報		2016年9月26日 需給予想		2016年9月27日 当社予想	
銀行券	▲ 200		800		2,000	
財政	▲ 4,100		2,300		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 4,300		3,100		▲ 2,000	
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			2,400	▲ 2,000		
国債買現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	8,100					
CP等買入		▲ 800		▲ 600		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援	800	▲ 1,000				
社債等買入		▲ 100	1,300	▲ 100		
ＥＴＦ買入	500		100			
国債補完供給	▲ 1,500	1,100		1,500		
当預増減	2,800		5,700		5,500	

当座預金残高	3,121,800	3,127,500	3,133,000
準備預金残高	2,814,700		
積み終了先	2,334,300		
超過準備	2,332,700		
非準備預金先	307,100		

9月26日以降の残り所要積立額	
積数	11,100
1日平均	600

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	99.46%	日数	33.33%

●2016年9月23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5,000億円減少の234兆円（当預金残高見込みは312兆4,000億円）。本日の無担O/N物は、地銀業態から▲0.04%～▲0.03%、証券業態から▲0.05%～▲0.04%、都銀・信託業態から▲0.075%～▲0.07%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.07%～▲0.03%の幅広いレンジでの出合い。日銀金融政策決定会合にて政策金利が据え置きになったことで調達意欲が回復し、レートは前日対比でやや上昇した。ターム物は、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(9/26-9/27)は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。S/N（9/27-9/28）は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。日銀による短国買入オペが通知されたものの、投資家の資金調達意欲はしっかりで、横ばい圏での推移となった。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、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は横ばい圏で推移。アウトライト市場は短国買入オペが7,500億円で実施された。応札額は9,863億円と少なく、平均利回較差▲0.008%、按分利回較差▲0.035%と好需給を反映した結果になった。オペ後は3Mで▲0.40%の出合いが見られた程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく、総額400億円程度の出合いと閑散だった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/23	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.054				－	▲ 0.085
T/N							－	▲ 0.081
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.032				－	▲ 0.147
2W							－	▲ 0.135
3W							－	▲ 0.135
1M							－	▲ 0.135
3M							▲ 0.343	▲ 0.168
6M							▲ 0.318	▲ 0.225
1Y							▲ 0.358	▲ 0.227

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.055	▲ 0.025	16,754.02	▲ 53.60	100.84-85	100.99-01

日付	9/14	9/15	9/16	9/20	9/21
日銀当預残	3,036,900	3,025,800	3,066,900	3,096,200	3,119,000
準備預金残	2,725,600	2,722,900	2,762,600	2,788,400	2,818,600
マネタリーベース	4,042,500	4,032,500	4,075,200	4,104,900	4,128,600
無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.065%	▲0.060%	▲0.060%	▲0.061%
コール市場残高	77,674	77,879	75,052	70,748	72,540
うち無担	57,337	58,540	55,001	51,149	52,639
うち有担	20,337	19,339	20,051	19,599	19,901

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
流動性供給	222	－	5,000	2016/9/27	－	15,906.0	4,995.00		▲0.0230%	75.0000%		▲0.0310%	

●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	7,500	2016/9/27			9,863	7,500	▲0.035		▲0.008	87.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	98,335	2016/9/23	2016/9/26		998	998		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	81,264	2016/9/23	2016/9/26		433	433		▲0.600	▲0.600	

●2016年9月26日の予定

*黒田日銀総裁、大阪経済4団体共催懇談会にて講演
*4-6月期の資金循環統計速報
*7月の景気動向指数改訂状況
*米国8月の新築一戸建て販売件

◆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。
◆本資料は何ら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論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