

Central Daily Market Report

2016年9月26日(月)
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26日		2016年9月27日		2016年9月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		0		0	
財政	2,300		▲ 7,200		▲ 11,000	
資金過不足	3,200		▲ 7,200		▲ 11,000	
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					12,800	
CP等買入		▲ 600		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,300	▲ 100				
E T F買入	100		100			
国債補完供給	▲ 1,600	1,500		1,600		
当預増減	4,200		1,300		1,800	
当座預金残高	3,126,000		3,127,300		3,129,100	
準備預金残高	2,819,600					
積み終了先	2,341,500				9月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,341,500				積数	9,700
非準備預金先	306,400				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	99.53%	日数	36.67%		

●2016年9月26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8,000億円増加の234兆8,000億円(当預金残高見込みは312兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、地銀・証券業態から▲0.050%~▲0.030%、都銀・信託業態から▲0.070%~▲0.065%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.065%~▲0.030%の幅広いレンジでの出会い。一日を通して各業態の調達意欲は堅調で、一巡後は▲0.070%~▲0.035%の出会いを中心に推移した。ターム物は、閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(9/27-9/28)は、▲0.08~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/28-9/29)は、▲0.08~▲0.085%程度の出合い。日銀による国債買入オペアが通知されるも、投資家の資金調達意欲がしっかりと前日比横ばいでの推移となった。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、売り物も少なく、出会いの見られない閑散とした展開に終始した。

<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、ノンバンク業態などから大型の発行案件が実施され、1,200億円程度の規模となった。発行レートについては、期越物への積極的な買い姿勢が後退する動きが見られ、概ね横ばい圏での落ち着いた水準での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2016/9/26	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	▲ 0.075	0.050	▲ 0.050				-	▲ 0.084	▲ 0.064	▲ 0.009	16,544.56	▲ 209.46	100.91-93	100.60-63
T/N			0.000				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.149						
2W							-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.135						
1M			▲ 0.038				-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.342	▲ 0.168						
6M							▲ 0.317	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.356	▲ 0.226						
									日付	9/15	9/16	9/20	9/21	9/23
									日銀当預残	3,025,800	3,066,900	3,096,200	3,119,000	3,121,800
									準備預金残	2,722,900	2,762,600	2,788,400	2,818,600	2,814,400
									マネタリーベース	4,032,500	4,075,200	4,104,900	4,128,600	4,131,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.065%	▲ 0.060%	▲ 0.060%	▲ 0.061%	▲ 0.054%
									コール市場残高	77,879	75,052	70,748	72,540	73,065
									うち無担	58,540	55,001	51,149	52,639	53,108
									うち有担	19,339	20,051	19,599	19,901	19,957

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/9/28			10,468	4,004	▲0.005		▲0.001	76.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/9/28			9,788	4,206	▲0.007		▲0.005	65.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/9/28			13,054	4,310	▲0.009		▲0.008	79.3
国債買入(物価連動債)	250	2016/9/28			1,031	251	▲0.200		▲0.265	31.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,765	2016/9/26	2016/9/27		1,285	1,285		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2016/9/26	2016/9/27		304	304		▲0.600	▲0.600	

●2016年9月27日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(7/28、29日分)	*米国7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(5,000億円、9/29発行)
*8月の企業向けサービス価格指数	*米国9月のCB消費者信頼感指数	

◆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