

# Central Daily Market Report

2016年8月3日(水)

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8月3日		2016年8月4日		2016年8月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		0		▲ 1,000	
財政	▲ 46,700		▲ 19,100		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 46,100		▲ 19,100		▲ 3,000	
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	12,500					
国債買入	9,000				7,800	
CP等買入		▲ 100		▲ 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		▲ 100				
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 500	300		500		
当預増減	▲ 25,000		▲ 18,600		4,800	
当座預金残高	2,971,200		2,952,600		2,957,400	
準備預金残高	2,671,900					
積み終了先	2,214,500		8月4日以降の残り所要積立額		積数 4,800	
超過準備	2,214,500		1日平均		400	
非準備預金先	299,300					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,139,400	
準備預金進捗率	実績	99.78%	日数	61.29%		

## ●2016年8月3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1兆4,000億円減の221兆8,000億円(当座預金残高見込みは、297兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.05~▲0.02%での調達で始まった。法人税・年金保険料揚げ日にあたったことで調達ニーズが強く、一巡後も同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、ロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(8/4-8/5)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(8/5-8/8)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。T/N,S/Nともにほぼ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幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、2Y366、5Y125~128、10Y336~342、20Y155~157、30Y48~51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、4日に3M入札を控えていることもあって様子見の姿勢が強く、3M▲0.26%の出合いが見られた程度であった。

### <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5・10日発行にあたり、電機・商社業態等から大型発行案件が実施され、1,100億円程度の償還に対して、1,600億円弱の発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での決着となっており、目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/8/3	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.084	▲ 0.090	▲ 0.025	16,083.11	▲ 308.34	101.07-10	101.04-06
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.094						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.272	▲ 0.178						
6M							▲ 0.260	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.272	▲ 0.229						
									日付	7/27	7/28	7/29	8/1	8/2
									日銀当預残	3,023,500	3,018,300	3,027,900	3,008,700	2,996,200
									準備預金残	2,720,800	2,704,700	2,713,700	2,702,300	2,700,000
									マネタリーベース	4,033,000	4,029,200	4,039,500	4,019,300	4,006,100
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.031%	▲0.046%	▲0.040%	▲0.039%
									コール市場残高	80,999	82,437	73,883	74,283	79,100
									うち無担	61,124	63,144	54,184	55,538	59,529
									うち有担	19,875	19,293	19,699	18,745	19,571

## ●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	棄分率	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)
交付税特会	-	-	10,500	2016/8/12	2017/2/13	77,676.0	10,500.0		0.0010%	13.5179%		0.0010%	

## ●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5年超10年以下)	4,300	2016/8/5			10,988	4,302	▲0.033		▲0.028	100.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/8/5			6,177	2,002	0.002		0.004	96.8
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/8/5			4,234	1,204	0.005		0.006	86.0
国債買入(物価連動債)	250	2016/8/5			1,212	250	▲0.360		▲0.561	65.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,357	2016/8/3	2016/8/4		444	444		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年8月4日の予定

*岩田日銀副総裁、神奈川県金融経済懇談会にて講演	*英中銀MPC結果発表 *米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫	*国庫短期証券(624回)入札(3ヶ月、44,000億円、8/8発行) *10年物価連動国債入札(4,000億円、8/8発行)
--------------------------	------------------------------------	--

◆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