Central Daily Market Report

2016年8月4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8月4日 需給速報		2016年8月5日 需給予想		2016年8月8日 当社予想	
銀行券	100		0		1,000	
財政	▲ 20,300		3,300		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 20,200		3,300		▲ 4,000	
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					2,000	▲ 4,800
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
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		
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 1,200	500		1,200		
当預増減	▲ 20,900		11,800		▲ 6,800	

当座預金残高	2,950,300	2,962,100	2,955,300
準備預金残高	2,654,000		
積み終了先	2,198,400		
超過準備	2,198,400		
非準備預金先	296,300		

8月5日以降の残り所要積立額	
積数	4,500
1日平均	400

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	99.79%	日数 64.52%

●2016年8月4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1兆7,000億円減の220兆1,000億円(当座預金残高見込みは、295兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.045～▲0.02%での調達で始まった。昨日と同様、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(8/5-8/8)は、▲0.08～▲0.075%程度の出合い。S/N(8/8-8/9)は、▲0.075～▲0.07%程度の出合い。S/NはTDB3M物発行の影響で売物が増加した印象。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。本日は3M入札が実施された。慎重な応札姿勢を反映し、平均落札利回▲0.2100%、按分落札利回▲0.1844%という結果になり、按分落札利回は今年4月以来の▲0.10%台での決着となった。セカンダリー市場は▲0.24～▲0.21%の堅調な水準で推移した。

<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、600億円弱の償還に対して、1,200億円程度の発行となった。商社業態よりまとまった発行が見られた。発行レートは横ばい圏で推移した。また、CP等買入オペが3,500億円でオファーされ、平均落札利回0.000%、按分落札利回▲0.001%と、ほぼ前回と変わらずの結果であった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/4	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	▲ 0.038				－	▲ 0.082
T/N	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.029				－	▲ 0.078
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	0.050	▲ 0.009				－	▲ 0.087
2W							－	▲ 0.092
3W			0.060				－	▲ 0.096
1M	0.001	0.010	0.002				－	▲ 0.102
3M							▲ 0.228	▲ 0.174
6M							▲ 0.263	▲ 0.229
1Y							▲ 0.271	▲ 0.230

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)
▲ 0.080	0.010	16,254.89	171.78	101.34-35	101.39-42

日付	7/28	7/29	8/1	8/2	8/3
日銀当預残	3,018,300	3,027,900	3,008,700	2,996,200	2,971,200
準備預金残	2,704,700	2,713,700	2,702,300	2,700,000	2,671,900
マネタリーベース	4,029,200	4,039,500	4,019,300	4,006,100	3,980,500
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.046%	▲0.040%	▲0.039%	▲0.041%
コール市場残高	82,437	73,883	74,283	79,100	79,622
うち無担	63,144	54,184	55,538	59,529	60,698
うち有担	19,293	19,699	18,745	19,571	18,924

●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)
国庫短期証券	624	－	43,900	2016/8/8	2016/11/7	144,931.0	40,099.8	100.0460	▲0.1844%	65.3541%	100.0524	▲0.2100%	3,800.0
物価連動10年	21	0.10%	4,000	2016/8/8	2026/3/10	11,397.0	3,999.00	104.2000	▲0.3240%	72.0512%			

●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	2016/8/8	2016/8/22		2,040	2,040				
CP等買入	3,500	2016/8/9			10,688	3,476	▲0.001		0.000	10.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	107,092	2016/8/4	2016/8/5		1,092	1,092		▲0.500	▲0.502	

●2016年8月5日の予定

*6月の毎月勤労統計調査速報
*6月の景気動向指数速報
*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国6月の貿易収支
*米国6月の消費者信用残高
*米国7月の雇用統計

◆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