Central Daily Market Report

2016年8月9日（火）
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9日 需給速報		2016年8月10日 需給予想		2016年8月12日 当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	600		▲ 16,300		▲ 8,000	
資金過不足	300		▲ 17,200		▲ 9,000	
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	200	▲ 100				▲ 100
国債買現						
国庫短期証買入	15,000					
国債買入	12,700					
CP等買入	3,500	▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 400	300		400		
当預増減	31,300		▲ 17,200		▲ 9,100	

当座預金残高	2,983,700	2,966,500	2,957,400
準備預金残高	2,683,800		
積み終了先	2,231,100		
超過準備	2,231,100		
非準備預金先	299,900		

8月10日以降の残り所要積立額	
積数	1,900
1日平均	300

積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			2,152,100
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数 80.65%

●2016年8月9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1兆4,000億円増の223兆1,000億円(当座預金残高見込みは、298兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.065～▲0.02%の幅広いレンジでの出合いで始まった。一巡後は▲0.06%近辺の出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件での出合いが中心であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/10-8/12)は、▲0.08～▲0.075%程度の出合い。S/N(8/12-8/15)は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。S/Nは積み最終日が近づき、若干資金調達ニーズが減少した。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、30Y48～50などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/Nは低位横ばい圏で推移。目立った材料もなく閑散とした中、3M物で▲0.228%の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

償還総額2,200億円程度に対して、発行総額は1,200億円弱と償還超となった。一部で大型案件が散見されたものの、夏季休暇前ということもあってか案件数自体は然程でもなく、マーケットは比較的閑散であった。発行レートに特段の動きは見られず、期内の償還物で小幅に上昇した程度であった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/9	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.048				－	▲ 0.081
T/N	▲ 0.035	0.000	▲ 0.032				－	▲ 0.080
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	0.010	▲ 0.009				－	▲ 0.085
2W			0.000				－	▲ 0.087
3W							－	▲ 0.094
1M							－	▲ 0.100
3M							▲ 0.228	▲ 0.166
6M							▲ 0.250	▲ 0.229
1Y							▲ 0.263	▲ 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）
▲ 0.085	▲ 0.030	16,764.97	114.40	102.28-30	102.42-44

日付	8/2	8/3	8/4	8/5	8/8
日銀当預残	2,996,200	2,971,200	2,950,300	2,961,400	2,952,400
準備預金残	2,700,000	2,671,900	2,654,000	2,674,900	2,665,500
マネタリーベース	4,006,100	3,980,500	3,959,400	3,970,500	3,960,800
無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.041%	▲0.038%	▲0.037%	▲0.045%
コール市場残高	79,100	79,622	75,956	78,777	77,124
うち無担	59,529	60,698	57,250	59,955	59,154
うち有担	19,571	18,924	18,706	18,822	17,970

●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)
30年利付国債	51	0.30%	8,000	2016/8/12	2046/6/20	22,260.0	7,254.0	96.5000	0.4320%	50.4725%	96.7100	0.4240%	742.0
エネルギー対策	－	－	6,000	2016/8/19	2017/8/21	29,696.0	5,999.99		0.0010%	20.2049%		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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	121,334	2016/8/9	2016/8/10		361	361		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月10日の予定

*6月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.1%）

*7月の企業物価指数
*米国7月の財政収支

*国庫短期証券（626回）入札
（3ヶ月、44,000億円、8/15発行）

◆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