

Central Daily Market Report

2016年8月10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10日		2016年8月12日		2016年8月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 700		0	
財政	▲ 16,000		▲ 7,300		36,000	
資金過不足	▲ 16,800		▲ 8,000		36,000	
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				▲ 100	1,900	▲ 5,100
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入					11,400	
CP等買入		▲ 400		▲ 1,200		
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			1,100			
国債補完供給	▲ 200	400		200		
当預増減	▲ 17,000		▲ 8,000		44,200	
当座預金残高	2,966,700		2,958,700		3,002,900	
準備預金残高	2,675,300					
積み終了先	2,221,400		8月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,221,300		積数		1,000	
非準備預金先	291,400		1日平均		200	
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	99.95%	日数	87.10%		

●2016年8月10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8,000億円減の222兆3,000億円(当座預金残高見込みは、296兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.06~▲0.02%の調達で始まった。休日を挟む取引ということもあり、調達ニーズの強い先も見られ、一部で▲0.015%まで取り上がる動きも見られた。一巡後は、朝方と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、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオファーされ、応募額1,941億円(期落ち分5,100億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(8/12-8/15)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(8/15-8/16)は、▲0.075~▲0.07%程度の出合い。S/Nは年金払いなどで大幅な資金余剰となるものの、短期3M発行要因から前日比で1bp程度のレート上昇となった。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、30Y48~50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物は低位横ばいで推移。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引では▲0.245~▲0.225%での出合いが見られたが、入札結果は平均落札利回▲0.2224%・按分落札利回▲0.1844%と、先週同様小甘い結果となった。セカンダリーでは▲0.227~▲0.210%での出合いが見られた。また、引け際には6M物で▲0.248~▲0.235%での出合いが少額ながら見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、五・十日に係る発行となったものの、全体の発行総額は900億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/10	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	▲ 0.047				-	▲ 0.083	▲ 0.110	▲ 0.025	16,735.12	▲ 29.85	101.92-94	101.48-49
T/N			0.000				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.226	▲ 0.163						
6M							▲ 0.249	▲ 0.229						
1Y							▲ 0.263	▲ 0.230						
									日付	8/3	8/4	8/5	8/8	8/9
									日銀当預残	2,971,200	2,950,300	2,961,400	2,952,400	2,983,700
									準備預金残	2,671,900	2,654,000	2,674,900	2,665,500	2,683,800
									マネタリーベース	3,980,500	3,959,400	3,970,500	3,960,800	3,992,300
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.038%	▲0.037%	▲0.045%	▲0.048%
									コール市場残高	79,622	75,956	78,777	77,124	80,781
									うち無担	60,698	57,250	59,955	59,154	62,241
									うち有担	18,924	18,706	18,822	17,970	18,540

●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	素分率	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)
国庫短期証券	626	-	43,700	2016/8/15	2016/11/14	130,753.0	40,099.8	100.0460	▲0.1844%	30.6867%	100.0555	▲0.2224%	3,600.0

●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	応募総額(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	2016/8/15	2016/8/29		1,941	1,941				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/8/15			11,193	4,008	▲0.008		▲0.005	62.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/8/15			9,743	4,209	▲0.004		▲0.003	70.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/8/15			5,881	2,002	▲0.019		▲0.015	40.9
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/8/15			3,533	1,204	0.000		0.002	85.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,974	2016/8/10	2016/8/12		210	210		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/8/12	2016/8/18	0.9	0	0				

●2016年8月12日の予定

*6月のマネタリーサーベイ	*米国8月のミシガン大学消費者信頼感指数速報	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/23借入)
*米国6月の企業在庫	*ユーロ圏4-6月期のGDP速報値	
*米国7月の生産者物価指数		
*米国7月の小売売上高		

◆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