

# Central Daily Market Report

2016年8月15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8月15日		2016年8月16日		2016年8月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		600			0
財政	31,100		3,500			3,000
資金過不足	32,100		4,100			3,000
<b>金融調節</b>	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	1,900	▲ 5,100				
国債買現						
国庫短期証買入			30,000			
国債買入	11,800		5,400			
CP等買入		▲ 800		▲ 300		
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	200					
国債補完供給	▲ 1,000	200		1,000		
当預増減	39,200		40,200			3,000
当座預金残高	2,997,700		3,037,900			3,040,900
準備預金残高	2,713,600					
積み終了先	2,245,800				8月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,245,800				積数	2,142,600
非準備預金先	284,100				1日平均	69,100
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						2,142,600
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2016年8月15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、前営業日比3兆円増の224兆2,000億円(当座預金残高見込みは、299兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.015%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。積み最終日の取引ということもあり調達ニーズが強く、邦銀、証券業態による▲0.04~▲0.015%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は調整程度の調達が見られる中、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(8/16-8/17)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(8/17-8/18)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。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。市場に目立った材料はなく、閑散であった。オペで在庫が若干軽くなったためか、3M物で▲0.227%の少額の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。発行市場は事業法人の夏季休暇が重なったためか、償還・発行共に案件は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/8/15	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	売買参考値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.080	▲ 0.089	0.021	16,869.56	▲ 50.36	101.25-27	101.07-09
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.033	▲ 0.015	▲ 0.027				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.230	▲ 0.162						
6M							▲ 0.250	▲ 0.230						
1Y							▲ 0.258	▲ 0.230						
									日付	8/5	8/8	8/9	8/10	8/12
									日銀当預残	2,961,400	2,952,400	2,983,700	2,966,700	2,958,500
									準備預金残	2,674,900	2,665,500	2,683,800	2,675,300	2,667,100
									マネタリーベース	3,970,500	3,960,800	3,992,300	3,976,100	3,968,500
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.045%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.041%
									コール市場残高	78,777	77,124	80,781	79,453	81,963
									うち無担	59,955	59,154	62,241	60,702	63,004
									うち有担	18,822	17,970	18,540	18,751	18,959

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,059	2016/8/15	2016/8/16		781	781		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	37,029	2016/8/15	2016/8/16		196	196		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年8月16日の予定

\*米国7月の消費者物価指数  
\*米国7月の住宅着工件数  
\*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率

\*英国7月の英消費者物価指数

\*流動性供給入札(4,000億円、8/18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