

Central Daily Market Report

2016年8月16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16日 | | 2016年8月17日 | | 2016年8月18日 | |
|-----------------------|------------|--------|------------|-------|-----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 500 | | 100 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 3,000 | | 1,400 | | ▲ 3,000 | |
| 資金過不足 | 3,500 | | 1,500 | | ▲ 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 | | | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | 30,000 | | | | | |
| 国債買入 | 5,400 | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | | ▲ 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 | | | | | | |
| E T F買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | 1,000 | | 300 | | |
| 当預増減 | 39,300 | | 1,600 | | ▲ 4,000 | |
| 当座預金残高 | 3,037,000 | | 3,038,600 | | 3,034,600 | |
| 準備預金残高 | 2,732,400 | | | | | |
| 積み終了先 | 1,187,000 | | | | 8月17日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 636,200 | | | | 積数 | 513,300 |
| 非準備預金先 | 304,600 | | | | 1日平均 | 17,100 |
| 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 | 76.04% | 日数 | 3.23% | | |

●2016年8月16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3兆円増の227兆2,000億円(当座預金残高見込みは、303兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.05~▲0.03%での調達で始まった。新積み期に入ったことから前日までの積極的な調達は一服し、やや水準を切下げて推移し、午前の取引を終えた。午後は▲0.05%で調整の出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、1M以内で▲0.03~▲0.02%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/17-8/18)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/18-8/19)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、閑散とした中、3M物で▲0.240%の出合いが散見された程度であった。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額・発行総額共に350億円程度とほぼ横ばい。事業法人の夏季休暇が重なったためか、案件数は少なく、マーケットは非常に閑散であった。発行レートに特段の動きは見られなかった。CP等買入オペがオファー額3,500億円で実施され、入札結果は平均落札利回0.000%・按分落札利回▲0.001%と、前回とほぼ同様の結果となった。

●短期金融市場関連指標

| 2016/8/16 | 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 | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.044 | | | | - | ▲ 0.084 | ▲ 0.099 | ▲ 0.010 | 16,596.51 | ▲ 273.05 | 101.25-27 | 100.31-33 |
| T/N | | | ▲ 0.001 | | | | - | ▲ 0.087 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.030 | ▲ 0.020 | ▲ 0.022 | | | | - | ▲ 0.087 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.025 | 0.000 | ▲ 0.015 | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.093 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.020 | | | | - | ▲ 0.097 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.230 | ▲ 0.162 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.250 | ▲ 0.230 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.253 | ▲ 0.230 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 8/8 | 8/9 | 8/10 | 8/12 | 8/15 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 2,952,400 | 2,983,700 | 2,966,700 | 2,958,500 | 2,997,700 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 2,665,500 | 2,683,800 | 2,675,300 | 2,667,100 | 2,713,600 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 3,960,800 | 3,992,300 | 3,976,100 | 3,968,500 | 4,006,600 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.045% | ▲0.048% | ▲0.047% | ▲0.041% | ▲0.029% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 77,124 | 80,781 | 79,453 | 81,963 | 76,640 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 59,154 | 62,241 | 60,702 | 63,004 | 58,144 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 17,970 | 18,540 | 18,751 | 18,959 | 18,496 |

●入札結果

| 名称 | 回号 | 表面利率 | 発行予定額(億円) | 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1非価格競争入札(億円) |
|-------|-----|------|-----------|-----------|-----|---------|----------|-------|-------------|----------|--------|-------------|---------------|
| 流動性供給 | 219 | - | 4,000 | 2016/8/18 | - | 6,747.0 | 3,996.00 | | 0.0220% | 88.5714% | | 0.0100% | |

●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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| CP等買入 | 3,500 | 2016/8/19 | | | 7,374 | 3,489 | ▲0.001 | | 0.000 | 59.8 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 26,945 | 2016/8/16 | 2016/8/17 | | 268 | 268 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 12,659 | 2016/8/16 | 2016/8/17 | | 6 | 6 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 米ドル資金供給 | | 2016/8/18 | 2016/8/25 | 0.9 | 12 | 12 | | | | |

●2016年8月17日の予定

*国庫短期証券(627回)入札
(1年、25,000億円、8/22発行)

*国有林野借入
(981億円、8/25借入)

◆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