

# Central Daily Market Report

2016年8月17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17日		2016年8月18日		2016年8月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 500		▲ 1,000	
財政	1,300		▲ 3,900		2,000	
資金過不足	1,500		▲ 4,400		1,000	
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						
国債買入					7,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 200	3,500	
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	▲ 200	300		200		
当預増減	1,400		▲ 4,400		12,000	
当座預金残高	3,038,400		3,034,000		3,046,000	
準備預金残高	2,739,900					
積み終了先	2,155,000				8月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,954,600				積数	195,700
非準備預金先	298,500				1日平均	6,700
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	90.87%			日数	6.45%

## ●2016年8月17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3,000億円増の227兆5,000億円(当座預金残高見込みは303兆9,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀調達で▲0.03%で寄付した後、▲0.055~▲0.03%の出合いが見られ、午前の取引を終えた。午後▲0.06%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで▲0.025~▲0.02%の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(8/18-8/19)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/19-8/22)も、▲0.09~▲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>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。本日は新発1Y物の入札が実施された。入札結果は平均落札利回▲0.2480%、按分落札利回▲0.2410%と堅調な結果となった。セカンダリーでは▲0.34~▲0.285%が出合うなど、買い進まれる展開となった。その他、3M物で▲0.25~▲0.24%での出合いが散見された。

### <CP市場>

CP発行市場は償還総額が800億円強に対して、発行総額は1,300億円強と発行超。事業法人の夏季休暇が明けつつあり、前倒しの5・10日発行となったためマーケットは多少活況となった。発行レートに特段の動きは見られないものの、期内の償還物や発行残高が積み上がった一部の銘柄では小幅に上昇するものも見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2016/8/17	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				-	▲ 0.085	▲ 0.085	0.014	16,745.64	149.13	100.17-19	100.70-72
T/N			0.000				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	▲ 0.003	▲ 0.021				-	▲ 0.087						
2W							-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.093						
1M			0.200				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.230	▲ 0.148						
6M							▲ 0.250	▲ 0.227						
1Y							▲ 0.325	▲ 0.228						
									日付	8/9	8/10	8/12	8/15	8/16
									日銀当預残	2,983,700	2,966,700	2,958,500	2,997,700	3,037,000
									準備預金残	2,683,800	2,675,300	2,667,100	2,713,600	2,732,400
									マネタリーベース	3,992,300	3,976,100	3,968,500	4,006,600	4,045,500
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.047%	▲0.041%	▲0.029%	▲0.044%
									コール市場残高	80,781	79,453	81,963	76,640	74,263
									うち無担	62,241	60,702	63,004	58,144	54,956
									うち有担	18,540	18,751	18,959	18,496	19,307

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	627	-	25,000	2016/8/22	2017/8/21	109,140.0	22,694.7	100.2410	▲0.2410%	83.5740%	100.2480	▲0.2480%	2,305.0
国有林野借入	-	-	981	2016/8/25	2021/8/25	3,313.0	981.00		0.0010%	43.0080%		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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/8/19			9,589	4,302	0.009		0.012	60.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/8/19			7,021	2,011	0.012		0.014	47.2
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/8/19			3,469	1,201	▲0.003		0.003	60.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/8/17	2016/8/18		197	197		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年8月18日の予定

*7月の貿易統計	*国庫短期証券(628回)入札(3ヶ月、44,000億円、8/22発行)	*5年利付国債入札(24,000億円、8/22発行)
*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値		

◆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