

Central Daily Market Report

2016年8月18日(木)

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18日		2016年8月19日		2016年8月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 500			0
財政	▲ 3,600		600		▲ 47,000	
資金過不足	▲ 4,000		100		▲ 47,000	
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					1,900	▲ 2,000
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 200	3,500	▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 4,200		11,300		▲ 47,100	
当座預金残高	3,034,200		3,045,500		2,998,400	
準備預金残高	2,740,400					
積み終了先	2,208,200				8月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,180,200				積数	101,700
非準備預金先	293,800				1日平均	3,600
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	95.25%	日数	9.68%		

●2016年8月18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1兆円減の226兆5,000億円(当座預金残高見込みは303兆4,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態で▲0.06~▲0.03%の出合い、午後は目立った出合いが見られなかった。固定金利方式による共通担保資金供給オペは8,000億円で2W物がオファーされ、応札額1,891億円(期落ち額2,040億円)の札割れとなった。ターム物はロール案件の出合いが見られた程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/19-8/22)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/22-8/23)は、▲0.08~▲0.07%程度の出合い。S/Nは短国3M・1Yおよび5Y国債の発行等の要因から、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>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。本日は新発3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.255~▲0.245%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.2341%、按分落札利回▲0.2124%と堅調な結果となった。セカンドラリーでは▲0.240%で少額の出合いが見られた程度。その他、6M物で▲0.255%での出合いが散見された。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額約1,000億円に対して、発行総額は1,500億円弱と発行超。夏季休暇明けの事業法人による資金調達ニーズが高まったためか、案件数が増加し、マーケットはやや活況であった。発行レートに特段の動きは見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/18	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	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.060	0.050	▲ 0.045				-	▲ 0.085	▲ 0.085	0.000		16,486.01	▲ 259.63	99.89-91	100.02-03
T/N	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.088							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.025	▲ 0.022	▲ 0.024				-	▲ 0.085							
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.086							
3W							-	▲ 0.091							
1M							-	▲ 0.095							
3M							▲ 0.239	▲ 0.141							
6M							▲ 0.250	▲ 0.223							
1Y							▲ 0.325	▲ 0.225							
									日付	8/10	8/12	8/15	8/16	8/17	
									日銀当預残	2,966,700	2,958,500	2,997,700	3,037,000	3,038,400	
									準備預金残	2,675,300	2,667,100	2,713,600	2,732,400	2,739,900	
									マネタリーベース	3,976,100	3,968,500	4,006,600	4,045,500	4,046,600	
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.041%	▲0.029%	▲0.044%	▲0.044%	
									コール市場残高	79,453	81,963	76,640	74,263	79,155	
									うち無担	60,702	63,004	58,144	54,956	59,834	
									うち有担	18,751	18,959	18,496	19,307	19,321	

●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	628	-	43,600	2016/8/22	2016/11/21	153,196.0	39,742.8	100.0530	▲0.2124%	66.5619%	100.0584	▲0.2341%	3,857.0
5年利付国債	128	0.10%	24,000	2016/8/22	2021/6/20	77,800.0	21,780.00	101.2800	▲0.1630%	91.8863%	101.2900	▲0.1650%	2,210.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/8/22	2016/9/5		1,891	1,891				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/8/18	2016/8/19		228	228		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月19日の予定

*特にありません。

◆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