Central Daily Market Report

2016年8月19日（金）
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19日 需給速報		2016年8月22日 需給予想		2016年8月23日 当社予想	
銀行券	▲ 200		600		▲ 1,000	
財政	900		▲ 53,000		2,000	
資金過不足	700		▲ 52,400		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			1,900	▲ 2,000		
国債買現						
国庫短期証買入					25,000	
国債買入	8,000				12,500	
CP等買入	3,500	▲ 500		▲ 600		
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			200			
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	11,700		▲ 52,700		38,500	

当座預金残高	3,045,900	2,993,200	3,031,700
準備預金残高	2,737,200		
積み終了先	2,264,300	8月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,243,400	積数	20,900
非準備預金先	308,700	1日平均	800
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 99.02%	日数	19.35%

●2016年8月19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7,000億円増の227兆2,000億円(当座預金残高見込みは304兆6,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態で▲0.055～▲0.025%の出合いが見られた。週末を挟む取引となるものの、積み期間の序盤である事から取り急ぐ動きはなく、取引水準に大きな変化は見られなかった。ターム物はロール案件の出合いが散見された程度であった。

<レポ市場>
GC T/N(8/22-8/23)は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。S/N（8/23-8/24）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、40Y9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。短国買入オペが前回比で5,000億円の減額となる2兆5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差＋0.014%、按分落札利回較差＋0.002%と、落ち着いた結果となった。セカンダリー市場では3M物で▲0.237～▲0.235%、6M物で▲0.260～▲0.255%での出合いが散見され、ほぼ横ばいの水準で取引された。

<CP市場>
CP発行市場は償還総額が500億円強に対して、発行総額は200億円弱と償還超。案件数少なく、少額案件を中心とする閑散としたマーケットとなった。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

2016/8/19	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				－	▲ 0.084
T/N			0.000				－	▲ 0.080
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	0.230	▲ 0.013				－	▲ 0.086
2W							－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.092
1M							－	▲ 0.096
3M							▲ 0.239	▲ 0.142
6M							▲ 0.253	▲ 0.224
1Y							▲ 0.299	▲ 0.225

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.090	▲ 0.005	16,545.82	59.81	100.13-15	100.13-16

日付	8/12	8/15	8/16	8/17	8/18
日銀当預残	2,958,500	2,997,700	3,037,000	3,038,400	3,034,200
準備預金残	2,667,100	2,713,600	2,732,400	2,739,900	2,740,400
マネタリーベース	3,968,500	4,006,600	4,045,500	4,046,600	4,042,900
無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.029%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.045%
コール市場残高	81,963	76,640	74,263	79,155	75,561
うち無担	63,004	58,144	54,956	59,834	56,091
うち有担	18,959	18,496	19,307	19,321	19,470

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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
国庫短期証券買入	25,000	2016/8/23			38,383	25,002	0.002		0.014	89.1
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2016/8/23			10,567	4,003	▲0.011		▲0.007	10.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2016/8/23			9,040	4,203	▲0.008		▲0.006	27.9
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2016/8/23			10,013	4,307	▲0.013		▲0.011	72.3
社債等買入	1,000	2016/8/25			2,583	1,000	▲0.205		▲0.160	94.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	30,000	2016/8/19	2016/8/22		197	197		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月22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論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