

Central Daily Market Report

2016年8月22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22日		2016年8月23日		2016年8月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 52,700		▲ 900		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 52,300		▲ 1,000		▲ 3,000	
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			25,100			
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 600		▲ 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	200		1,400			
国債補充供給	▲ 900	200		900		
当預増減	▲ 53,500		38,900		▲ 3,000	
当座預金残高	2,992,400		3,031,300		3,028,300	
準備預金残高	2,703,900					
積み終了先	2,235,500		8月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,235,300		積数	18,300		
非準備預金先	288,500		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	99.15%	日数	22.58%		

●2016年8月22日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備残高見込みは、前日比3兆6,000億円減の223兆6,000億円(当座預金残高見込みは299兆3,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・証券業態で▲0.06~▲0.025%の出合いが見られた。一巡後は▲0.06~▲0.05%で調整程度の出合いがあり、午前中の取引を終えた。午後は目立った出合いは見られなかった。ターム物はロール案件の出合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/23-8/24)は、▲0.090~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/24-8/25)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、10Y336~343、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は同水準で推移した。材料少なく閑散な中、3Mが▲0.235%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

CP市場は、機械、電気機器、商社等の業態でまとまった額の調達が行われ、発行総額は1,700億円程度と、償還総額1,000億円程度を上回った。期間の短い物、残高が積みあがっている物で一部レートが伸びる動きが見られたが、全体としては0%近辺で決着した。

●短期金融市場関連指標

2016/8/22	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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)	為替(17時)			
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.083	▲ 0.075	0.015	16,598.19	52.37	100.55-57	100.77-78				
T/N			0.000				-	▲ 0.088										
S/N							-	-										
1W	▲ 0.025	0.003	▲ 0.013				-	▲ 0.087										
2W							-	▲ 0.088										
3W			0.050				-	▲ 0.091										
1M			0.003				-	▲ 0.095										
3M							▲ 0.239	▲ 0.140										
6M							▲ 0.254	▲ 0.224										
1Y							▲ 0.291	▲ 0.225										
													日付	8/15	8/16	8/17	8/18	8/19
													日銀当預残	2,997,700	3,037,000	3,038,400	3,034,200	3,045,900
													準備預金残	2,713,600	2,732,400	2,739,900	2,740,400	2,737,200
													マネタリーベース	4,006,600	4,045,500	4,046,600	4,042,900	4,054,700
													無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.045%	▲0.047%
													コール市場残高	76,640	74,263	79,155	75,561	77,303
													うち無担	58,144	54,956	59,834	56,091	57,869
													うち有担	18,496	19,307	19,321	19,470	19,434

●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	募入最高利回り	棄分率	募入平均価格	募入平均利回り	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・利回り較差・価格較差	全取レート・利回り較差・価格較差	平均落札レート・利回り較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)	65,217	2016/8/22	2016/8/23		748	748		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)	6,781	2016/8/22	2016/8/23		118	118		▲0.500	▲0.500	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オペ	第64回	2016/8/26	2017/8/25	0	428					
被災地金融支援オペ(熊本)	第3回	2016/8/26	2017/8/25	0	467					

●2016年8月23日の予定

*黒田日銀総裁、FinTechフォーラムにおいて講演	*20年利付国債入札(11,000億円、8/25発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/31借入)
*米国7月の新築一戸建て販売件数		

◆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