

●資金需給

単位：億円	2016年8月23日		2016年8月24日		2016年8月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 100		▲ 1,000	
財政	0		▲ 2,200		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 200		▲ 2,300		▲ 12,000	
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	25,100					
国債買入	12,700					
CP等買入		▲ 200		▲ 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						1,000
ETF買入	1,400					
国債補充供給	▲ 200	900		200		
当増減	39,500		▲ 2,600		▲ 11,000	
当座預金残高	3,031,900		3,029,300		3,018,300	
準備預金残高	2,728,800					
積み終了先	2,263,000		8月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,263,000		積数		16,400	
非準備預金先	303,100		1日平均		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	99.23%	日数	25.81%		

●2016年8月23日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比3兆円増の226兆6,000億円(当座預金残高見込みは303兆1,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀調達で▲0.03%の寄り付き後、邦銀、証券業態で▲0.06~▲0.03%と前日横ばい圏のレンジで推移し午前の取引を終えた。また一部では試し取りが行われ0.001%の出合いも散見された。午後は▲0.06%で小額の出合いが見られた。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(8/24-8/25)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/25-8/26)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S/N物は引き続き低位で推移した。3M物は、▲0.235~▲0.233%でまとまった出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は五・十日発行に当たり、化学、石油、小売等の業態でまとまった額の発行が見られ、償還総額600億円弱に対し、発行総額は1,800億円程度と活況だった。昨日に引続き、一部残高が積みあがっている先でレート上昇圧力が観測されたものの、全体としては0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/8/23	無担(速報)			有担(速報)			短期 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)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.086	▲ 0.095	▲ 0.020	16,497.36	▲ 100.83	100.27-28	100.09-11
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.237	▲ 0.140						
6M							▲ 0.255	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.281	▲ 0.225						

●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)
20年利付国債	157	0.20%	11,000	2016/8/25	2036/6/20	38,613.0	9,971.0	98.3500	0.2880%	95.3568%	98.3800	0.2860%	1,021.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/8/31	2017/2/28	75,645.0	10,500.05		0.0010%	13.8808%		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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2016/8/23	2016/8/24		185	185		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/8/25	2016/9/1	0.9	11	11				

●2016年8月24日の予定

*月例経済報告
*6月の景気動向指数改訂状況
*米国7月の中古住宅販売

◆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お客様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