

Central Daily Market Report

2016年8月25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25日		2016年8月26日		2016年8月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,100		0	
財政	▲ 12,200		500		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 13,100		▲ 600		▲ 11,000	
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	▲ 1,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			900	▲ 400		
社債等買入	1,000	▲ 100				
ETF買入			200			
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 12,500		12,200		▲ 11,000	
当座預金残高	3,016,400		3,028,600		3,017,600	
準備預金残高	2,725,700					
積み終了先	2,256,600		8月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,256,600		積数		13,100	
非準備預金先	290,700		1日平均		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	99.39%	日数	32.26%		

●2016年8月25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8,000億円減の225兆5,000億円(当座預金残高見込みは301兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態で▲0.06~▲0.03%の出合いが見られた。一巡後は▲0.06~▲0.055%で調整的に出合い。また試し取りから0.001%の出合いも見られた。午後は目立った出合いは見られなかった。固定金利方式による共通担保資金供給オペアは8,000億円が2W物がオファーされた。1,891億円の応札(期落ち額1,941億円)があったものの、引き続き未達となった。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(8/26-8/29)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/29-8/30)は、▲0.085~▲0.08%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、2Y366~367、5Y125~128、10Y336~343、20Y132、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物は低水準で推移した。本日は3M物の入札が実施された。入札結果は、WI取引において▲0.25~▲0.245%とやや強めの水準で出合っていたものの、平均落札利回▲0.2280%、按分落札利回▲0.2104%と概ね事前予想通りの無難な結果となった。セカンダリーでは、▲0.24~▲0.235%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、少額の発行が数件行われた程度で、発行総額は140億円程と閑散だった。発行レートは引続き、0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2016/8/25	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.088	▲ 0.090	▲ 0.005	16,555.95	▲ 41.35	100.56-57	100.39-42
T/N			▲ 0.002				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.240	▲ 0.139						
6M							▲ 0.254	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.270	▲ 0.230						
									日付	8/18	8/19	8/22	8/23	8/24
									日銀当預残	3,034,200	3,045,900	2,992,400	3,031,900	3,028,900
									準備預金残	2,740,400	2,737,200	2,703,900	2,728,800	2,728,300
									マネタリーベース	4,042,900	4,054,700	4,000,800	4,040,500	4,037,500
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%
									コール市場残高	75,561	77,303	71,394	79,528	76,662
									うち無担	56,091	57,869	51,563	59,691	57,181
									うち有担	19,470	19,434	19,831	19,837	19,481

●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	素分率	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	629	-	44,300	2016/8/29	2016/11/28	181,365.0	40,202.9	100.0525	▲0.2104%	14.0219%	100.0569	▲0.2280%	4,097.0
流動性供給	220	-	5,000	2016/8/29	-	19,236.0	4,992.0		▲0.0120%	1.4492%		▲0.0150%	
交付税特会	-	-	10,500	2016/9/2	2017/3/2	79,158.0	10,500.06		0.0010%	13.2648%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/8/29	2016/9/12		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	2016/8/25	2016/8/26		186	186		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/8/25	2016/8/26		61	61		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月26日の予定

*7月全国・8月都区部消費者物価指数(CPI)
市場予想：全 国(7月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%
東京都都区部(8月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.3%

*米国4-6月期のGDP改定値
*英国4-6月期のGDP改定値

◆本資料は信頼できるとさ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