

Central Daily Market Report

2016年8月29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29日		2016年8月30日		2016年8月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		400		▲ 1,200	
財政	▲ 20,200		1,300		▲ 1,500	
資金過不足	▲ 20,300		1,700		▲ 2,700	
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			10,000			
国債買入			5,300		11,400	
CP等買入		▲ 500		▲ 600	3,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 400	500		400		
当預増減	▲ 20,700		16,600		12,200	
当座預金残高	3,007,100		3,023,700		3,035,900	
準備預金残高	2,727,000					
積み終了先	2,259,400					
超過準備	2,259,400					
非準備預金先	280,100					
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					2,141,800	
準備預金進捗率	実績	99.65%	日数	45.16%		

●2016年8月29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1兆2,000億円減の225兆6,000億円(当座預金残高見込みは300兆8,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀調達で▲0.025%の寄付きとなった。その後は邦銀、証券業態で▲0.06~▲0.02%で出合い、午前の取引を終えた。午後は目立った出合いは見られなかった。ターム物はショートターム中心で▲0.02%近辺で出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/30-8/31)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(8/31-9/1)は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。S/Nは、月末要因から売り手の資金調達意欲が弱く、レートは低下した。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、10Y342・10Y343のオファーが出難く、O/N中心に締まったレベルでの取引となった。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は3M物で▲0.275%と、先週のオペを受けやや強含みでの出合いが見られた。

<CP市場>

発行市場は償還総額9,800億円程度に対し、月末発行から幅広い業態で発行案件が見られたものの、発行総額は7,000億円弱程度と償還超となった。発行レートは概ね横ばいながらも、長めの案件ではマイナスでの発行も散見された。

●短期金融市場関連指標

2016/8/29	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.085		▲ 0.070	0.005			101.92-94	102.29-31
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.040				-	▲ 0.090				16,737.49	376.78		
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.089							
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.090							
3W							-	▲ 0.093							
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.098							
3M							▲ 0.246	▲ 0.139							
6M							▲ 0.254	▲ 0.219							
1Y							▲ 0.262	▲ 0.220							
										日付	8/22	8/23	8/24	8/25	8/26
										日銀当預残	2,992,400	3,031,900	3,028,900	3,016,400	3,027,800
										準備預金残	2,703,900	2,728,800	2,728,300	2,725,700	2,734,400
										マネタリーベース	4,000,800	4,040,500	4,037,500	4,026,000	4,038,500
										無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.044%
										コール市場残高	71,394	79,528	76,662	76,280	75,763
										うち無担	51,563	59,691	57,181	56,532	56,447
										うち有担	19,831	19,837	19,481	19,748	19,316

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/8/31			9,121	4,007	▲0.003		0.001	26.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/8/31			7,412	4,203	0.005		0.008	22.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/8/31			6,465	2,000	0.014		0.020	94.3
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/8/31			4,216	1,204	0.005		0.011	32.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	45,310	2016/8/29	2016/8/30		382	382		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月30日の予定

*7月の完全失業率(市場予想:3.1%)	*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(23,000億円、9/15発行)
*7月の有効求人倍率(市場予想:1.38倍)	*米国8月のCB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、9/7借入)
*7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲0.9%)		
*7月の商業動態統計速報		

◆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