# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

	貝並需桁							
	*	2016年8	3月31日	2016年	9月1日	2016年9月2日		
	単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社	予想	
	銀行券		200		0	1,000		
	財政		900	<b>A</b>	10, 200	<b>A</b>	11, 000	
	資金過不足		1, 100	<b>A</b>	10, 200	<b>1</b> 0,000		
	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	
ΙI	貸出							
Ш	全店共通							
Ш	国債買現							
Ш	国庫短期証買入							
Ш	国債買入	11, 700						
Ш	CP等買入	3, 500	<b>2</b> , 900		▲ 300			
Ш	貸出支援基金(成)					4, 700	<b>▲</b> 1, 200	
Ш	貸出支援基金(貸)							
Ш	被災地支援							
Ш	社債等買入		▲ 100					
Ш	ETF買入			100				
	国債補完供給	<b>▲</b> 2,000	400		2, 000			
	当預増減		11, 700		8, 400		6,500	
当	座預金残高	3,	035, 000	3,	026, 600	3, 020, 100		
	準 <u>備預金残高</u>	2,	731, 100					
	積み終了先	2,	268, 200		9月1日以	降の残り所	i要積立額	
	超過準備	2,	267, 900		積数		5, 700	
Ш	非準備預金先		303, 900		1日平均		400	
積。	み期間(8/16~	9/15) σ.	)所要準	備額		2,	141, 700	
_								

## ●2016年8月31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、前日比同額の227兆1,000億円(当 座預金残高は303兆7,000億円)。本日の無担O/Nは月末で参加者が少ない 中、邦銀調達で▲0.03%の寄付きとなり、その後は邦銀・証券業態の調達で ▲0.065~▲0.03%の出合い。一巡後も動意に乏しく、▲0.065%の出合いが 見られた程度で前場の取引を終えた。午後は目立った出合いが見られな かった。ターム物はショートタームで▲0.025~▲0.02%の出合い。

### 〈レポ市場〉

GC T/N(9/1-9/2)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(9/2-9/3) は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/Nは、目立った要因もなく、レートは 横ばい圏内での取引となった。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、各年限のカレント近辺の銘柄にビッドの 出入りが多く見られ、O/N中心に活発な取引となった。

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特段の材料も無く、 閑散であった。

### 〈CP市場〉

51.61%

CP市場は電機業態から大型発行案件が見られたものの、発行、償還ともに 少なく閑散なマーケットとなった。

JGB新発10年債

# ●短期金融市場関連指標

実績

準備預金進捗率

2016/8/31		無担 (連報)			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	売買参考統計值	平均值
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.086
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.088
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.088
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.089
3W							-	▲ 0.094
1 M			▲ 0.030				_	▲ 0.104
3M		-					▲ 0.250	▲ 0.136
6M							▲ 0.255	▲ 0.224
1Y							▲ 0.257	▲ 0.225

日数

99. 73%

直記	直近値 前日比		3比	比 15時時点		TIME.	前日比		為替(9時)	為替(17時)			
<b>A</b> 0	0.069	0.0	009	16	,887.40		162.04		102.88-89	103.27-28			
	日付		8/2	4	8/25		8/26		8/29	8/30			
日銀当	4預残		3,028,	900	3,016,4	00	3,027,80	)(	3,007,100	3,023,300			
準備預	<b>頁金残</b>		2,728,	300	2,725,7	00	2,734,40	)(	2,727,000	2,736,000			
マネタ	リーベー	ース	4,037	500	4,026,0	00	4,038,50	)(	4,018,000	4,033,800			
無担O	/N加重	平均	▲0.0	47%	▲0.04	7%	▲0.04	49	6 ▲0.046%	▲0.046%			
コール	市場残	高	76,	662	76,2	80	75,76	33	72,646	77,313			
	<b>う</b> 7	ち無担	57,	181	56,5	32	56,44	47	53,635	58,489			
	<b>أ</b> ر	ち有担	19,	481	19,7	48	19,3	16	19,011	18,824			

日経平均株価

ドル/円

# ●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 競争入礼(億円)	ĺ
				木口	け財務省に	よる国信	等の 入 利し	十宝施され	1 キせんでし	<b>t-</b>				ı

# ●オペ結果

稚類	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,883	2016/8/31	2016/9/1		1,954	1,954		▲0.500	▲0.781	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,755	2016/8/31	2016/9/1		9	9		▲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・百万ドル)	貸付先數
成長基盤強化	本則第25回	2016/9/2	2020/9/2	0	4,437	53
成長基盤強化	本則第13回(借り換え)	2016/9/2	2017/9/1	0	259	36
成長基盤強化	ABL等特則第21期	2016/9/5	2020/9/4	0	4	2
成長基盤強化	小口特則第18期	2016/9/2	2020/9/2	0	8.78	12
成長基盤強化	小口特則第6期(借り換え)	2016/9/2	2017/9/1	0	1.14	5
成長基盤強化	米ドル特則第17期	2016/9/2	2017/9/5		110	17
成長基盤強化	米ドル特則第13期(借り換え)	2016/9/2	2017/9/5		14	14
成長基盤強化	米ドル特則第9期(借り換え)	2016/9/2	2017/9/5		1,558	35
成長基盤強化	米ドル特則第5期(借り換え)	2016/9/2	2017/9/5		1.273	19

# ●2016年9月1日の予定

\*4-6月期の法人企業統計調査季報

\*国庫短期証券(630回)入札 (3ヶ月、44,000億円、9/5発行) \*10年利付国債入札 (24,000億円、9/20発行) \*交付税特別会計借入 (10,500億円、9/9借入)

- \*米国7月の建設支出 \*米国8月のISM製造業景況指数
- ◆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