

Central Daily Market Report

2016年8月31日(水)

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31日	2016年9月1日	2016年9月2日
需給速報	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	200	0	1,000
財政	900	▲ 10,200	▲ 11,000
資金過不足	1,100	▲ 10,200	▲ 10,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入			
国債買入	11,700		
CP等買入	3,500	▲ 2,900	▲ 300
貸出支援基金(成)			4,700
貸出支援基金(貸)			▲ 1,200
被災地支援			
社債等買入	▲ 100		
E T F 買入		100	
国債補完供給	▲ 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
準備預金残高	2,731,100		
積み終了先	2,268,200		9月1日以降の残り所要積立額
超過準備	2,267,900		積数
非準備預金先	303,900		1日平均
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			2,141,700
準備預金進捗率	実績	99.73%	日数
			51.61%

●短期金融市場関連指標

2016/8/31	無担(速報)			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	売買参考値	平均値
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
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.104
3M							▲ 0.250	▲ 0.136
6M							▲ 0.255	▲ 0.224
1Y							▲ 0.257	▲ 0.225

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.069	0.009	16,887.40	162.04	102.88-89	103.27-28

日付	8/24	8/25	8/26	8/29	8/30
日銀当預残	3,028,900	3,016,400	3,027,800	3,007,100	3,023,300
準備預金残	2,728,300	2,725,700	2,734,400	2,727,000	2,736,000
マネタリーベース	4,037,500	4,026,000	4,038,500	4,018,000	4,033,800
無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.044%	▲ 0.046%	▲ 0.046%
コール市場残高	76,662	76,280	75,763	72,646	77,313
うち無担	57,181	56,532	56,447	53,635	58,489
うち有担	19,481	19,748	19,316	19,011	18,824

●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)	授付レート ・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	授付 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)	貸付先数
成長基盤強化	本則第25回	2016/9/2	2020/9/2	0	4,437
成長基盤強化	本則第13回(借り換え)	2016/9/2	2017/9/1	0	259
成長基盤強化	ABL等特則第21期	2016/9/5	2020/9/4	0	4
成長基盤強化	小口特則第18期	2016/9/2	2020/9/2	0	8.78
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
成長基盤強化	米ドル特則第17期	2016/9/2	2017/9/5		110
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
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
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

●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