Central Daily Market Report

2016年8月8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8日 需給速報		2016年8月9日 需給予想		2016年8月10日 当社予想	
銀行券	800		▲ 200		0	
財政	▲ 7,000		200		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 6,200		0		▲ 16,000	
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	2,000	▲ 4,800	200	▲ 100		
国債買現						
国庫短期証買入			15,000			
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 200	3,500	▲ 300		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給	▲ 300	500		300		
当預増減	▲ 9,000		31,400		▲ 16,000	

当座預金残高	2,952,400	2,983,800	2,967,800
準備預金残高	2,665,500		
積み終了先	2,211,700		
超過準備	2,211,700		
非準備預金先	286,900		

8月9日以降の残り所要積立額	
積数	2,500
1日平均	400

積み期間（7/16～8/15）の所要準備額	2,152,100
準備預金進捗率　実績 99.88%	日数 77.42%

●2016年8月8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、前営業日比3,000億円減の221兆7,000億円(当座預金残高見込みは、295兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.065～▲0.015%の調達で始まった。引き続き調達ニーズが強い先が見られたことで、幅広いレンジでの出合いとなった。一巡後も同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られず、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/9-8/10)は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。S/N(8/10-8/12)は、▲0.085～▲0.07%程度の出合い。S/Nは短国6Mの発行要因でレート上昇して始まったものの、売り一巡後は買い進まれ、レートは若干低下した。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、2Y366、5Y125～128、10Y336～342、20Y155～157、30Y48～51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物は低位横ばいで推移。短国市場は6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.265～▲0.25%での出合いが見られたものの、入札結果は平均落札利回▲0.2397%・按分落札利回▲0.2021%と、慎重な入札姿勢を反映した結果となった。セカンダリーでは出合いが見られなかった。その他、3M物で▲0.228%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は五・十日に係る発行となり、一部大型の発行案件が見られたものの、全体の発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは期内償還物で小幅ながら上昇する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/8/8	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	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.045				－	▲ 0.084
T/N			0.000				－	▲ 0.080
S/N			0.000				－	－
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.016				－	▲ 0.086
2W							－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.094
1M							－	▲ 0.100
3M							▲ 0.228	▲ 0.169
6M							▲ 0.250	▲ 0.229
1Y							▲ 0.267	▲ 0.230

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）
▲ 0.055	0.045	16,650.57	396.12	102.05-06	102.28-30

日付	8/1	8/2	8/3	8/4	8/5
日銀当預残	3,008,700	2,996,200	2,971,200	2,950,300	2,961,400
準備預金残	2,702,300	2,700,000	2,671,900	2,654,000	2,674,900
マネタリーベース	4,019,300	4,006,100	3,980,500	3,959,400	3,970,500
無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.039%	▲0.041%	▲0.038%	▲0.037%
コール市場残高	74,283	79,100	79,622	75,956	78,777
うち無担	55,538	59,529	60,698	57,250	59,955
うち有担	18,745	19,571	18,924	18,706	18,822

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	625	－	35,000	2016/8/10	2017/2/10	105,708.0	31,734.9	100.1020	▲0.2021%	19.2923%	100.1210	▲0.2397%	3,265.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	78,686	2016/8/8	2016/8/9		254	254		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月9日の予定

*7月のマネーストック
*米国6月の卸売売上高
*TB2M（発行中止）
*30年利付国債入札
（8,000億円、8/12発行）
*エネルギー対策借入
（6,000億円、8/19借入）

◆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