Central Daily Market Report

2016年8月12日（金）
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12日 需給速報		2016年8月15日 需給予想		2016年8月16日 当社予想	
銀行券	▲ 600		800		1,000	
財政	▲ 7,400		30,100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 8,000		30,900		0	
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		▲ 100	1,900	▲ 5,100		
国債買現						
国庫短期証買入					30,000	
国債買入			11,800		5,300	
CP等買入		▲ 1,200		▲ 800		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入	1,100		200			
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 8,200		39,000		35,300	

当座預金残高	2,958,500	2,997,500	3,032,800
準備預金残高	2,667,100		
積み終了先	2,212,100		
超過準備	2,211,800		
非準備預金先	291,400		

8月15日以降の残り所要積立額	
積数	0
1日平均	0

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	100.00%	日数 96.77%

●2016年8月12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1兆1,000億円減の221兆2,000億円(当座預金残高見込みは、295兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.06～▲0.015%の調達で始まった。積み最終日を翌営業日に控え、調達ニーズの強い先も見られ、一部で▲0.01%まで取り上がる動きも見られた。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/15-8/16)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。S/N(8/16-8/17)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/Nは国債・短国買入オペが通知された影響でレートは低下した。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、2Y366、5Y125～128、10Y336～342、20Y155～157、30Y48～50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物は低位横ばい圏で推移。3M物で▲0.230～▲0.226%、6M物で▲0.255～▲0.249%の出合いが見られた。短国買入オペが30,000億円で実施され、平均落札利回＋0.007%、按分落札利回±0%と落ち着いた結果となった。オファー額が膨らんだ事もあり、オペ後は少額の買いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。夏季休暇の影響もあり、発行案件に乏しく閑散であった。発行総額は200億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/12	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.041				－	▲ 0.079
T/N			0.000				－	▲ 0.075
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.086
2W			0.000				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.093
1M							－	▲ 0.099
3M							▲ 0.228	▲ 0.163
6M							▲ 0.249	▲ 0.230
1Y							▲ 0.263	▲ 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）
▲ 0.110	0.000	16,919.92	184.80	101.84-85	102.05-07

日付		8/4	8/5	8/8	8/9	8/10
日銀当預残		2,950,300	2,961,400	2,952,400	2,983,700	2,966,700
準備預金残		2,654,000	2,674,900	2,665,500	2,683,800	2,675,300
マネタリーベース		3,959,400	3,970,500	3,960,800	3,992,300	3,976,100
無担O/N加重平均		▲0.038%	▲0.037%	▲0.045%	▲0.048%	▲0.047%
コール市場残高		75,956	78,777	77,124	80,781	79,453
	うち無担	57,250	59,955	59,154	62,241	60,702
	うち有担	18,706	18,822	17,970	18,540	18,751

●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)
交付税特会	－	－	10,500	2016/8/23	2017/2/23	80,399.0	10,500.08		0.0010%	13.0600%		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
国庫短期証券買入	30,000	2016/8/16			43,435	30,007	0.000		0.007	47.5
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2016/8/16			9,795	4,305	▲0.008		▲0.004	11.2
国債買入（変動利付債）	1,000	2016/8/16			3,956	1,006	0.000		▲0.062	93.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	112,300	2016/8/12	2016/8/15		231	231		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月15日の予定

*4-6月期のGDP1次速報
（市場予想：前期比年率＋0.7%）

*6月の石油等消費動態統計

◆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