

Central Daily Market Report

2016年8月26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26日 需給速報	2016年8月29日 需給予想	2016年8月30日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	0	0			
財政	200	▲ 19,800	2,000			
資金過不足	▲ 900	▲ 19,800	2,000			
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			1,900	▲ 1,900		
国債買現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	12,100				5,300	
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	900	▲ 400				
社債等買入						
E T F買入	200					
国債補完供給	▲ 500	300		500		
当預増減	11,400	▲ 19,800			17,300	
当座預金残高	3,027,800	3,008,000			3,025,300	
準備預金残高	2,734,400					
積み終了先	2,265,700				8月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,265,700				積数	8,900
非準備預金先	293,400				1日平均	500
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						2,142,600
準備預金進捗率	実績	99.58%	日数	41.94%		

●2016年8月26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1兆3,000億円増の226兆8,000億円(当座預金残高見込みは302兆9,000億円)。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▲0.055~▲0.01%で出合い。一巡後は調整で▲0.06~▲0.055%で散発的な出合いが見られた。午後は閑散。ターム物はロール案件の出合いが見られた程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(8/29-8/30)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(8/30-8/31)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。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、5Y125~128、10Y336~343、20Y154~157、30Y48~51、40Y9などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートS/Nは同水準で推移した。本日は、短国買入オペが事前予想の下限である1兆円でオファーされた。応札も1兆5,211億円と少なく、平均利回較差+0.001% 按分利回較差▲0.006%と、しっかりの結果となった。オペ前、オペ後ともに出合いはなく、閑散な地合いだった。

<CP市場>

CP市場は、電気機器や小売業態等でまとまった額の調達が行われたものの、発行総額は1,600億円弱と、償還総額2,000億円程度を下回った。発行レートは、ロットが大きい発行案件で小幅上昇したものの、全体としては0%近辺で決着した。CP等買入オペは、事前発表通りの3,500億円でオファーされた。業者による玉の入替ニーズが強く、平均落札レート0.000%、按分落札レート▲0.001%と、按分・平均共に前回と同様の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2016/8/26	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.065	0.010	▲ 0.044				-	▲ 0.086	▲ 0.075	0.015	16,360.71	▲ 195.24	100.55-58	100.42-43		
T/N	▲ 0.050	▲ 0.002	▲ 0.043				-	▲ 0.087								
S/N							-	-								
1W			0.001				-	▲ 0.088								
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.090								
3W							-	▲ 0.093								
1M	▲ 0.023	▲ 0.015	▲ 0.021				-	▲ 0.097								
3M							▲ 0.245	▲ 0.141								
6M							▲ 0.254	▲ 0.219								
1Y							▲ 0.265	▲ 0.220								
											日付	8/19	8/22	8/23	8/24	8/25
											日銀当預残	3,045,900	2,992,400	3,031,900	3,028,900	3,016,400
											準備預金残	2,737,200	2,703,900	2,728,800	2,728,300	2,725,700
											マネタリーベース	4,054,700	4,000,800	4,040,500	4,037,500	4,026,000
											無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%
											コール市場残高	77,303	71,394	79,528	76,662	76,280
											うち無担	57,869	51,563	59,691	57,181	56,532
											うち有担	19,434	19,831	19,837	19,481	19,748

●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
国庫短期証券買入	10,000	2016/8/30			15,211	10,001	▲0.006		0.001	48.2
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/8/30			3,030	700	0.079		0.079	98.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/8/30			13,237	4,302	0.015		0.016	50.2
国債買入(物価連動債)	250	2016/8/30			1,502	251	▲0.360		▲0.401	24.8
CP等買入	3,500	2016/8/31			8,122	3,481	▲0.001		0.000	37.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	45,214	2016/8/26	2016/8/29		362	362		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/8/26	2016/8/29		100	100		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月29日の予定

- *7月の米個人所得・消費支出
- *英国休日(Summer Bank Holiday)

◆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