

Central Daily Market Report

2016年7月7日(木)

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7月7日		2016年7月8日		2016年7月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 600		2,000	
財政	▲ 20,500		2,400		▲ 54,000	
資金過不足	▲ 20,600		1,800		▲ 52,000	
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			100	▲ 600	2,700	▲ 4,100
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,100			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
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			800			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 20,800		14,900		▲ 53,400	
当座預金残高	3,033,000		3,047,900		2,994,500	
準備預金残高	2,740,100					
積み終了先	2,265,500					
超過準備	2,265,500					
非準備預金先	292,900					
			7月8日以降の残り所要積立額			
			積数		700	
			1日平均		100	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,076,200	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数		73.33%	

●2016年7月7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1兆4,000億円減少の226兆5,000億円(当座預金残高見込みは303兆1,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託・地銀より▲0.065%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.065~▲0.055%近辺での出会い。一巡後もほぼ同水準の出会いが散見された。ターム物は引き続き証券業態のロール案件が見られた程度であった。本日の共通担保資金供給オペは、2W物が8,000億円でおファーされ、応札額2,690億円(期落ち分4,130億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(7/8-7/11)は、▲0.085~▲0.075%程度のお合い。S/N(7/11-7/12)は、▲0.060~▲0.055%程度のお合い。S/Nは、短国の発行要因から資金調達ニーズが強く、レートを引き上げた。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、5Y128、10Y338~343、20Y155~157、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T/Nは低水準で推移した。アウトライ市場は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.33%~▲0.325%が出合うなど過熱する中、平均落札利回▲0.3234%、按分落札利回▲0.3032%と3M物では平均・按分共に過去最低レートを更新する強い入札となった。セカンダリーは引け際に▲0.305%と▲0.299%で小額のお合いが見られた程度となった。

<CP市場>

発行市場は償還総額1,100億円程度に対し、石油業態でまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,500億円程度となった。発行レートは概ね横ばいの推移となった。CP等買入オペが前日比1,500億円減額の3,500億円を実施された。結果は平均落札利回0.000%、按分落札利回▲0.001%と前回(平均▲0.001%、按分▲0.002%)から上昇した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
単位：%									▲0.280	▲0.005	15,276.24	▲102.75	101.14-15	101.02-03
O/N	▲0.100	▲0.020	▲0.055				-	▲0.084						
T/N			▲0.040				-	▲0.077						
S/N							-	-						
1W			▲0.050				-	▲0.096						
2W			0.080				-	▲0.100						
3W							-	▲0.109						
1M							-	▲0.120						
3M							▲0.312	▲0.217						
6M							▲0.436	▲0.230						
1Y							▲0.312	▲0.235						
									日付	6/30	7/1	7/4	7/5	7/6
									日銀当預残	3,032,800	3,042,800	3,007,700	3,050,200	3,053,800
									準備預金残	2,725,900	2,725,600	2,714,100	2,746,100	2,754,300
									マネタリーベース	4,039,400	4,050,300	4,014,400	4,055,900	4,059,100
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.058%	▲0.057%	▲0.054%	▲0.056%
									コール市場残高	58,667	77,486	69,151	75,042	71,103
									うち無担	43,033	57,069	49,124	54,982	52,293
									うち有担	15,634	20,417	20,027	20,060	18,810

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	619	-	43,700	2016/7/11	2016/10/11	141,303.0	39,727.8	100.0765	▲0.3032%	57.8260%	100.0816	▲0.3234%	3,972.0
流動性供給	217	-	2,000	2016/7/11	-	10,786.0	1,993.00		▲0.0150%	28.0868%		▲0.0180%	

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/7/11	2016/7/25		2,690	2,690				
CP等買入	3,500	2016/7/12			12,300	3,491	▲0.001		0.000	21.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/7/7	2016/7/8		88	88		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	18,202	2016/7/7	2016/7/8		27	27		▲0.600	▲0.600	

●2016年7月8日の予定

*5月の国際収支	*米国5月の消費者信用残高	*エネルギー対策借入(6,000億円、7/20借入)
*5月の毎月勤労統計調査速報	*米国6月の雇用統計	
*6月の景気ウォッチャー調査		

◆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