

Central Daily Market Report

2016年7月8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7月8日		2016年7月11日		2016年7月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		1,100		0	
財政	3,700		▲ 60,300		▲ 2,000	
資金過不足	3,200		▲ 59,200		▲ 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	100	▲ 600	2,700	▲ 4,100		
国債買現						
国庫短期証買入					30,000	
国債買入	13,100				11,400	
CP等買入		▲ 400		▲ 600	3,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	800		100			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	16,100		▲ 60,900		42,900	
当座預金残高	3,049,100		2,988,200		3,031,100	
準備預金残高	2,758,700					
積み終了先	2,283,000				7月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,282,900				積数	400
非準備預金先	290,400				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	99.98%	日数	83.33%		

●2016年7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、前日比1兆8,000億円増加の228兆3,000億円(当座預金残高見込みは304兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託・地銀より▲0.065~▲0.06%近辺の調達希望で始まった。週末であったものの、取り上がる動きは特段見られず、立ち上がりは▲0.065~▲0.055%近辺での出会い。その後は▲0.075~▲0.04%と幅広いレンジでの出会いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は引き続き証券業態のロール案件が散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/11-7/12)は、▲0.055~▲0.05%程度のお合い。S/N(7/12-7/13)は、▲0.08~▲0.075%程度のお合い。S/Nは、短国・利国買入オペを受けてレートを切り下げた。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。アウトライト市場は、短国買入オペが前回比10,000億円増額の30,000億円でオファーされた。平均利回較差+0.026%、按分利回較差+0.019%と最近の流動性の低いマーケットを反映し、小甘い結果となった。その他、6M物で▲0.399%~▲0.395%、1Y物で▲0.35%の少額のお合いが見られた。

<CP市場>

発行市場は償還総額2,200億円程度に対し、電機業態でまとまった発行案件が見られたものの、発行件数は少なく、発行総額は600億円程度と閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/8	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	
	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)
単位:%									▲ 0.290	▲ 0.010	15,106.98	▲ 169.26	100.75-77	100.60-62
O/N	▲ 0.075	0.000	▲ 0.053				-	▲ 0.076						
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.053						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.097						
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.313	▲ 0.212						
6M							▲ 0.392	▲ 0.231						
1Y							▲ 0.313	▲ 0.235						
									日付	7/1	7/4	7/5	7/6	7/7
									日銀当預残	3,042,800	3,007,700	3,050,200	3,053,800	3,033,000
									準備預金残	2,725,600	2,714,100	2,746,100	2,754,300	2,740,100
									マネタリーベース	4,050,300	4,014,400	4,055,900	4,059,100	4,038,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.057%	▲ 0.054%	▲ 0.056%	▲ 0.055%
									コール市場残高	77,486	69,151	75,042	71,103	67,023
									うち無担	57,069	49,124	54,982	52,293	47,632
									うち有担	20,417	20,027	20,060	18,810	19,391

●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)	募入最低値	募入最高利回・利回較差	素分率	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)
エネルギー対策	-	-	6,000	2016/7/20	2017/7/20	31,140.0	5,999.96		0.0010%	19.2679%		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	2016/7/12			59,425	30,000	0.019		0.026	79.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2016/7/12			9,237	3,751	▲0.029		▲0.012	42.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/7/12			13,087	4,402	▲0.005		▲0.003	22.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/7/12			6,650	2,001	0.002		0.006	40.4
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/7/12			5,311	1,205	0.003		0.007	78.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	64,439	2016/7/8	2016/7/11		188	188		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	21,605	2016/7/8	2016/7/11		17	17		▲0.600	▲0.600	

●2016年7月10日の予定

*参議院選挙投票

●2016年7月11日の予定

*5月の機械受注統計 (市場予想: 船舶電力除く民需、 前月比+2.6%)	*5月の特定サービス産業動態統計速報 *6月のマネーストック	*米国6月のFRB労働市場情勢指数
---	-----------------------------------	-------------------

◆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お客様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