

# Central Daily Market Report

2016年7月11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7月11日		2016年7月12日		2016年7月13日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	1,100		500		0		
財政	▲ 59,600		▲ 6,600		▲ 17,000		
資金過不足	▲ 58,500		▲ 6,100		▲ 17,000		
<b>金融調節</b>	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	2,700	▲ 4,100					
国債買現							
国庫短期証買入			30,000				
国債買入			11,900				
CP等買入		▲ 600	3,500	▲ 600			
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			
E T F買入	100						
国債補完供給	▲ 200	200		200			
<b>当預増減</b>	▲ 60,400		38,800		▲ 17,000		
<b>当座預金残高</b>	2,988,700		3,027,500		3,010,500		
準備預金残高	2,709,900						
積み終了先	2,233,500		7月12日以降の残り所要積立額				
超過準備	2,233,500		積数		200		
非準備預金先	278,800		1日平均		0		
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	99.99%	日数	86.67%

## ●2016年7月11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5兆8,000億円減少の222兆5,000億円(当座預金残高見込みは298兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託・地銀より▲0.06%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.06~▲0.055%の出合い。一巡後は一部でとりあがる動きも散見され、▲0.07~▲0.03%の出合いであった。ターム物は証券業態の調達が見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(7/12-7/13)は、▲0.080~▲0.075%程度の出合い。S/N(7/13-7/14)は、▲0.075~▲0.07%程度の出合い。SC個別銘柄では、5Y128、10Y336~343、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>

短国現先レートT/Nは、前日から横ばい圏の取引だった。短国アウトライト市場は、イベントが無く閑散で、目立った出合いが聞かれなかった。

### <CP市場>

CP市場は償還総額200億円程度に対し、発行総額は300億円程度だった。小売業態からのまとまった発行案件があったが、案件数は少なく、閑散との印象だった。発行レートは引き続き0%近辺の決着であった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/7/11	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)
O/N	▲ 0.075	0.000	▲ 0.053				-	▲ 0.080	▲ 0.280	0.010	15,708.82	601.84	100.68-70	101.89-91
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.098						
2W			0.000				-	▲ 0.100						
3W			0.080				-	▲ 0.112						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.314	▲ 0.211						
6M							▲ 0.384	▲ 0.231						
1Y							▲ 0.311	▲ 0.235						

## ●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	衆分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,575	2016/7/11	2016/7/12		91	91		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	31,590	2016/7/11	2016/7/12		83	83		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年7月12日の予定

*5月の第3次産業活動指数	*米国5月の卸売売上高	*30年利付国債入札 (8,000億円、7/14発行)
*6月の企業物価指数		

◆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