Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

● 貸金需給							
¥ /4 / 4 /5	2016年	7月12日	2016年	7月13日	2016年	7月14日	
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		500		500	▲ 1,000		
財政	4	6,000	A	15, 500	A 8, 000		
資金過不足	4	5, 500	A	15, 000	▲ 9,000		
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							
国債買現							
国庫短期証買入	30, 000						
国債買入	11, 900						
CP等買入	3, 500	▲ 600		▲ 100			
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							
国債補完供給	▲ 3,000			3, 000			
当預増減		36, 400	A	12, 100	4	9,000	
当座預金残高	3,	025, 100	3,	013, 000	3,	004, 000	
準備預金残高		735, 600					
積み終了先	2,	261, 900		7月13日以	降の残り	听要積立額	
超過準備		261, 800		積数		100	
非準備預金先		289, 500		1日平均		0	
積み期間 (6/16~	7/15) σ.)所要準	備額		2, 076, 200		
準備預金進捗率	実績		100.00%	日数		90.00%	

●2016年7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、前日比4兆9,000億円増加の227兆 4,000億円(当座預金残高見込みは302兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は 地銀・信託・証券より▲0.065~▲0.06%近辺の調達希望で始まった。立ち上 がりはテイクンで寄り付き▲0.06~▲0.055%の出合い。一巡後も地銀業態 の調達意欲は旺盛で▲0.035~▲0.025%の出合いが複数見られた。ターム 物は閑散であった。

〈レポ市場〉

GC T/N(7/13-7/14)は、▲0.075~▲0.07%程度の出合い。S/N(7/14-7/15)は、▲0.07~▲0.06%程度の出合い。SC個別銘柄では、5Y128、 10Y336~343、20Y155~157、30Y48~50、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 場は動意に乏しく、前日に続いて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1,000億円程度に対し、発行総額は1,400億円程度だっ た。建設、電機、機械等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行 レートは引続き低水準で推移したが、一部残高が積みあがった先等では、若 干上昇する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/7/12	無担(連報)				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	売買参考統計值	平均値	
O/N	▲ 0.078	0.000	▲ 0.050				-	▲ 0.081	
T/N			▲ 0.010				_	▲ 0.074	
S/N							-	-	
1W							-	▲ 0.096	
2W							-	▲ 0.100	
3W							-	▲ 0.111	
1M							_	▲ 0.122	
3M							▲ 0.313	▲ 0.211	
6M							▲ 0.382	▲ 0.230	
1Y							▲ 0.307	▲ 0.235	

JGB新発10年債					日経平	均	株価	ĺ	ドル/円			
直边	丘値	前	前日比		15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)		
A 0	.285	A (0.005	16,095.65			386.83		102.50-51	103.00-02		
	日付	寸 7/5		5	7/6		7/7		7/8	7/11		
日銀当	日銀当預残		3,050	,200	3,053,800		3,033,000		3,049,100	2,988,700		
準備預	準備預金残		2,746,100		2,754,300		2,740,100		2,758,700	2,709,900		
マネタ	マネタリーベース		4,055,900		4,059,100		4,038,500		4,055,100	3,993,600		
無担O	/N加重平均		▲0.054%		▲0.056%		▲0.055%		▲0.053%	▲0.053%		
コール市場残高		75,042		71,103		67,023		68,319	68,950			
	うち無担		54	,982	82 52,293		47,632		49,435	48,262		
	うち有担		20	.060	18.8	10	19.39	91	18.884	20.688		

●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)
30年利付国債	51	0.30%	8,000	2016/7/14	2046/6/20	19,222.0	7,276.0	104.4500	0.1440%	22.2857%	105.2000	0.1200%	721.0

●オペ結果

稚類	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)	51,580	2016/7/12	2016/7/13		2,958	2,958		▲0.600	▲0.614	
米ドル資金供給		2016/7/14	2016/7/21	0.89	180	180				

●2016年7月13日の予定

*5月のマネタリーサーベイ

*米国ベージュブック *米国6月の財政収支 *交付税特別会計借入 (10,500億円、7/22借入)

- ◆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