Central Daily Market Report

2016年7月13日（水）
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13日 需給速報		2016年7月14日 需給予想		2016年7月15日 当社予想	
銀行券	600		▲ 900		▲ 2,000	
財政	▲ 14,100		▲ 5,500		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 13,500		▲ 6,400		▲ 13,000	
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						
国債買入					7,500	
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
国債補完供給	▲ 3,600	3,000		3,600		
当預増減	▲ 14,200		▲ 3,200		▲ 5,500	

当座預金残高	3,010,900	3,007,700	3,002,200
準備預金残高	2,731,800		
積み終了先	2,260,600	7月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,260,600	積数	0
非準備預金先	279,100	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 100.00%	日数	93.33%

●2016年7月13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1兆9,000億円減少の225兆5,000億円(当座預金残高見込みは301兆3,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託・証券より▲0.06%近辺の調達希望で始まった。取り調整から調達意欲は引き続き旺盛で、立ち上がりは▲0.055～0.04%の出合い。一巡後も地銀業態の調達ニーズは強く▲0.02%まで取り上がる出合いも見られた。ターム物は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(7/14-7/15)は、▲0.06～▲0.055%程度の出合い。S/N(7/15-7/19)は、▲0.065～▲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、14日の3M物入札を控えていたものの、動きが見られず、引き続き目立った出合いは聞かれなかった。

<CP市場>

CP市場は償還総額1,500億円程度に対し、発行総額は2,500億円程度だった。五、十日発行に当たり、機械、石油、不動産等の業態からまとまった発行案件があった。発行レートは銘柄によって多少のばらつきがあるものの、引き続き低位横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2016/7/13	無担（速報）			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	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				－	▲ 0.077
T/N			0.000				－	▲ 0.057
S/N			0.000				－	－
1W			0.000				－	▲ 0.093
2W							－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.110
1M							－	▲ 0.120
3M							▲ 0.311	▲ 0.207
6M							▲ 0.360	▲ 0.229
1Y							▲ 0.303	▲ 0.235

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.285	0.000	16,231.43	135.78	104.72-74	104.21-23

日付	7/6	7/7	7/8	7/11	7/12
日銀当預残	3,053,800	3,033,000	3,049,100	2,988,700	3,025,100
準備預金残	2,754,300	2,740,100	2,758,700	2,709,900	2,735,600
マネタリーベース	4,059,100	4,038,500	4,055,100	3,993,600	4,029,500
無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.055%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.050%
コール市場残高	71,103	67,023	68,319	68,950	71,446
うち無担	52,293	47,632	49,435	48,262	52,074
うち有担	18,810	19,391	18,884	20,688	19,372

●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)
交付税特会	－	－	10,500	2016/7/22	2017/1/23	103,829.0	10,500.01		0.0010%	10.1129%		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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2016/7/15			13,599	4,308	0.006		0.008	13.2
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,000	2016/7/15			4,449	2,003	0.011		0.015	59.8
国債買入（残存期間25年超）	1,200	2016/7/15			3,022	1,203	0.029		0.035	11.5
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	41,562	2016/7/13	2016/7/14		3,523	3,523		▲0.600	▲0.605	

●2016年7月14日の予定

*英中銀MPC結果発表
*米国6月の生産者物価指数
*国庫短期証券（620回）入札
（3ヶ月、44,000億円、7/19発行）
*5年利付国債入札
（24,000億円、7/19発行）

◆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