# Central Daily Market Report

2016年7月14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14日 需給速報 | | 2016年7月15日 需給予想 | | 2016年7月19日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | ▲ 800 | | ▲ 800 | | 1,000 | |
| 財政 | ▲ 5,700 | | ▲ 9,000 | | ▲ 28,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 6,500 | | ▲ 9,800 | | ▲ 27,000 | |
| 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 | | | | | 4,000 | ▲ 2,800 |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | | | 8,100 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 400 | | ▲ 300 | | |
| 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 | | | 200 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 3,400 | 3,600 | | 3,400 | | |
| 当預増減 | ▲ 6,700 | | 1,500 | | ▲ 25,800 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 3,004,200 | 3,005,700 | 2,979,900 |
| 準備預金残高 | 2,727,100 | | |
| 積み終了先 | 2,256,700 | 7月15日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 2,256,700 | 積数 | 0 |
| 非準備預金先 | 277,100 | 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 | 96.67% |

## ●2016年7月14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7,000億円増加の226兆2,000億円(当座預金残高見込みは300兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は地銀・信託・証券より▲0.05%近辺の調達希望で始まった。積みの終盤であることから調達意欲は旺盛で、立ち上がりから徐々に取り上がり、▲0.045～▲0.035%の出合い。一巡後も調達ニーズは強く▲0.02%まで取り上がる出合いも見られた。ターム物は閑散であった。本日の共通担保資金供給オペは、2W物が8,000億円でオファーされ、応札額4,040億円（期落ち分2,830億円）の札割れとなった。

**<レポ市場>**

GC T/N(7/15-7/19)は、▲0.06～▲0.055%程度の出合い。S/N(7/19-7/20)は、▲0.055～▲0.05%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3M物の入札は按分レート▲0.2533%、平均レート▲0.2962%、按分比率9.25%となり、WI取引で▲0.325～▲0.31%の出合いが見られていたことからすると、やや軟調な結果であった。セカンダリーでは▲0.289%でごく小額の出合いが見られた。

**<CP市場>**

CP市場は償還総額400億円程度に対し、発行総額は700億円程度だった。鉄鋼、通信業態からのまとまった発行案件が見られたが、全体としては閑散だった。発行レートは、一部の銘柄で高止まりするものがあったが、概ね低位安定であった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/7/14 | 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 | ▲ 0.060 | 0.001 | ▲ 0.038 | | | | － | ▲ 0.078 |
| T/N | | | ▲ 0.010 | | | | － | ▲ 0.061 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | | | | | | | － | ▲ 0.088 |
| 2W | ▲ 0.050 | ▲ 0.020 | ▲ 0.039 | | | | － | ▲ 0.100 |
| 3W | | | ▲ 0.040 | | | | － | ▲ 0.109 |
| 1M | ▲ 0.040 | 0.200 | ▲ 0.018 | | | | － | ▲ 0.121 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.276 | ▲ 0.202 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.341 | ▲ 0.229 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.293 | ▲ 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) |
| ▲ 0.265 | 0.020 | 16,385.89 | 154.46 | 104.05-07 | 105.43-45 |

| 日付 | | 7/7 | 7/8 | 7/11 | 7/12 | 7/13 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | | 3,033,000 | 3,049,100 | 2,988,700 | 3,025,100 | 3,010,900 |
| 準備預金残 | | 2,740,100 | 2,758,700 | 2,709,900 | 2,735,600 | 2,731,800 |
| マネタリーベース | | 4,038,500 | 4,055,100 | 3,993,600 | 4,029,500 | 4,014,800 |
| 無担O/N加重平均 | | ▲0.055% | ▲0.053% | ▲0.053% | ▲0.050% | ▲0.044% |
| コール市場残高 | | 67,023 | 68,319 | 68,950 | 71,446 | 79,874 |
| | うち無担 | 47,632 | 49,435 | 48,262 | 52,074 | 60,079 |
| | うち有担 | 19,391 | 18,884 | 20,688 | 19,372 | 19,795 |

## ●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) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国庫短期証券 | 620 | － | 43,800 | 2016/7/19 | 2016/10/17 | 153,924.0 | 40,159.0 | 100.0625 | ▲0.2533% | 9.2500% | 100.0731 | ▲0.2962% | 3,641.0 |
| 5年利付国債 | 128 | 0.10% | 24,000 | 2016/7/19 | 2021/6/20 | 75,952.0 | 22,000.00 | 102.3100 | ▲0.3610% | 93.3874% | 102.3300 | ▲0.3650% | 1,991.0 |

## ●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 | 2016/7/19 | 2016/8/1 | | 4,040 | 4,040 | | | | |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 53,511 | 2016/7/14 | 2016/7/15 | | 3,321 | 3,321 | | ▲0.500 | ▲0.501 | |

## ●2016年7月15日の予定

*5月の石油等消費動態統計
*米国5月の企業在庫
*米国6月の消費者物価指数
*米国6月の小売売上高
*米国6月の鉱工業生産・設備稼働率
*米国7月のミシガン大
消費者信頼感指数速報
*ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値
*中国4-6月期GDP
*国庫短期証券(621回)入札
（1年、25,000億円、7/20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