

# Central Daily Market Report

2016年7月15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15日		2016年7月19日		2016年7月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		700		1,000	
財政	▲ 7,400		▲ 30,300		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 8,200		▲ 29,600		▲ 19,000	
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				8,900	
CP等買入		▲ 300		▲ 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				
E T F買入	200		600			
国債補完供給	▲ 3,400	3,400		3,400		
当預増減	▲ 300		▲ 24,700		▲ 10,100	
当座預金残高	3,003,900		2,979,200		2,969,100	
準備預金残高	2,722,500					
積み終了先	2,251,300		7月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,251,300		積数		103,600	
非準備預金先	281,400		1日平均		3,700	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,137,000	
準備預金進捗率	実績	95.15%	日数	9.68%		

## ●2016年7月15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1兆3,000億円減少の224兆9,000億円(当座預金残高見込みは300兆6,000億円)。本日は積み最終日にあたることに加え、次の積み期間に係ることもあり、調達ニーズは旺盛であった。朝方の無担O/N物は都銀・地銀・信託・証券より▲0.04%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりはテイコンで寄り付き、▲0.04~▲0.03%の出合い。一巡後は▲0.06~▲0.02%の幅広いレンジでの出合いが複数見られた。午後にかけても調達ニーズは強く▲0.03~▲0.02%の出合いが散見され本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/19-7/20)は、▲0.05~▲0.045%程度の出合い。S/N(7/20-7/21)は、▲0.05~▲0.045%程度の出合い。SC個別銘柄では、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、発行日要因から小幅に上昇した。短国1Y物の入札は、WI取引で▲0.36%の出合いが見られる中、結果は按分レート▲0.3289%、平均レート▲0.3587%、按分比率58.8039%で、概ね事前の予想通りだった。セカンダリーは徐々に買い進まれる展開となり、▲0.503~▲0.36%の出合いが見られた。その他、3M物で▲0.289%の出合いが小額見られた。

### <CP市場>

CP市場は償還総額900億円程度に対し、発行総額は2,500億円程度だった。五、十日発行にあたるため案件数が多く、通信、小売、建設等の業態からまとまった発行があった。発行レートは銘柄毎のばらつきはあったが、概ね横ばい圏であった。CP等買入オペは、事前の予定から変わらずの3,500億円で開催され、按分・平均レート共に▲0.001%、按分比率54.3%という結果になった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/7/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.066	▲ 0.235	0.030	16,497.85	111.96	105.14-16	105.85-88
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.053						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.087						
2W			0.000				-	▲ 0.100						
3W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.286	▲ 0.204						
6M							▲ 0.335	▲ 0.233						
1Y							▲ 0.500	▲ 0.235						
									日付	7/8	7/11	7/12	7/13	7/14
									日銀当預残	3,049,100	2,988,700	3,025,100	3,010,900	3,004,200
									準備預金残	2,758,700	2,709,900	2,735,600	2,731,800	2,727,100
									マネタリーベース	4,055,100	3,993,600	4,029,500	4,014,800	4,008,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.044%	▲0.038%
									コール市場残高	68,319	68,950	71,446	79,874	74,510
									うち無担	49,435	48,262	52,074	60,079	54,311
									うち有担	18,884	20,688	19,372	19,795	20,199

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	621	-	25,000	2016/7/20	2017/7/20	102,411.0	22,929.9	100.3300	▲0.3289%	58.8039%	100.3600	▲0.3587%	2,070.0

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/7/20			3,890	708	0.036		0.036	86.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2016/7/20			14,542	3,755	0.012		0.015	42.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/7/20			11,651	4,404	0.026		0.029	94.4
CP等買入	3,500	2016/7/21			8,853	3,483	▲0.001		▲0.001	54.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	55,130	2016/7/15	2016/7/19		3,338	3,338		▲0.500	▲0.501	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第63回	2016/7/22	2017/7/21	0	1,105
被災地金融支援オペ(熊本)	第2回	2016/7/22	2017/7/21	0	0

## ●2016年7月19日の予定

\*米国6月の住宅着工件数

\*英国6月の消費者物価指数

◆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