

Central Daily Market Report

2016年7月19日(火)
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19日		2016年7月20日		2016年7月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		300		▲ 2,000	
財政	▲ 30,500		▲ 18,300		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 29,800		▲ 18,000		▲ 4,000	
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					35,000	
国債買入			9,000		4,600	
CP等買入		▲ 300		▲ 500	3,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	600		300			
国債補完供給	▲ 500	3,400		500		
当預増減	▲ 25,400		▲ 8,700		39,100	
当座預金残高	2,978,500		2,969,800		3,008,900	
準備預金残高	2,696,500					
積み終了先	2,198,000				7月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,180,100				積数	57,700
非準備預金先	282,000				1日平均	2,100
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	97.30%	日数	12.90%		

●2016年7月19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、前営業日比2兆1,000億円減の22兆8,000億円(当座預金残高見込みは29兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.045~▲0.035%での調達で始まった。新しい積み期間に入った事で、取り手の数はやや減少したものの、引き続き調達ニーズは強く、レート水準に大きな変化は見られなかった。出会い一巡後は、閑散とした状況のなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/20~7/21)は、▲0.05~▲0.045%程度の出合い。S/N(7/21~7/22)は、▲0.08~▲0.075%程度の出合い。S/Nは、短国買入オベ等の要因があったことから、レートは低下した。SCIは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。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>

現先レートT/Nは低水準で推移した。短国買入オベが35,000億円でオファーされ、結果は平均利回較差+0.043%、按分利回較差+0.031%(按分比率55.7%)と、引値が低い特定の銘柄を中心に応札されたとみられる水準となった。また、オベ後に3Mで▲0.266%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は発行総額800億円程度であった。発行レートは概ね横ばいであったものの、一部特定銘柄において小幅上昇するものも見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/7/19	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.071	▲ 0.234	0.001	16,723.31	225.46	106.17-18	105.95-97
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.100						
3W			0.000				-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.129						
3M							▲ 0.276	▲ 0.203						
6M							▲ 0.314	▲ 0.233						
1Y							▲ 0.420	▲ 0.235						
									日付	7/11	7/12	7/13	7/14	7/15
									日銀当預残	2,988,700	3,025,100	3,010,900	3,004,200	3,003,900
									準備預金残	2,709,900	2,735,600	2,731,800	2,727,100	2,722,500
									マネタリーベース	3,993,600	4,029,500	4,014,800	4,008,800	4,009,300
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.050%	▲0.044%	▲0.038%	▲0.034%
									コール市場残高	68,950	71,446	79,874	74,510	73,996
									うち無担	48,262	52,074	60,079	54,311	53,923
									うち有担	20,688	19,372	19,795	20,199	20,073

●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	棄分率	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
国庫短期証券買入	35,000	2016/7/21			57,990	35,002	0.031		0.043	55.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/7/21			14,304	4,308	▲0.004		▲0.003	54.7
国債買入(物価連動債)	250	2016/7/21			1,510	252	▲0.630		▲0.734	16.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	74,880	2016/7/19	2016/7/20		482	482		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/7/19	2016/7/20		42	42		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/7/21	2016/7/28	0.89	180	180				

●2016年7月20日の予定

*20年利付国債入札 (11,000億円、7/22発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、7/28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