

Central Daily Market Report

2016年7月20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20日		2016年7月21日		2016年7月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 19,700		1,400		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 19,500		300		▲ 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			35,100			
国債買入	9,000		4,700			
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					1,100	▲ 1,100
社債等買入						
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 900	500		900		
当預増減	▲ 11,100		44,300		▲ 13,000	
当座預金残高	2,967,400		3,011,700		2,998,700	
準備預金残高	2,669,600					
積み終了先	2,187,200			7月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,183,300			積数	39,300	
非準備預金先	297,800			1日平均	1,500	
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	98.16%	日数	16.13%		

●2016年7月20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1兆8,000億円減の221兆円(当座預金残高見込みは297兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.045~▲0.03%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も同水準での出合いが散見されるなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/21-7/22)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。S/N(7/22-7/25)は、▲0.08~▲0.075%程度の出合い。S/Nは、目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内での推移となった。SC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、20Y155~156、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は前日の短国買入オペの影響もあって、小幅低下した。アウトライト市場は特段目立った材料もなく閑散としていた。3M物で▲0.265%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は商社、ノンバンク業態でまとまった発行が見られ、総額1,440億円程度の出合い。発行レートは概ね横ばいながらも、一部銘柄で若干の上昇が見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/7/20	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.068	▲ 0.243	▲ 0.009	16,681.89	▲ 41.42	106.12-14	106.33-34
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.230	0.013				-	▲ 0.087						
2W			0.010				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.269	▲ 0.193						
6M							▲ 0.308	▲ 0.233						
1Y							▲ 0.348	▲ 0.235						
									日付	7/12	7/13	7/14	7/15	7/19
									日銀当預残	3,025,100	3,010,900	3,004,200	3,003,900	2,978,500
									準備預金残	2,735,600	2,731,800	2,727,100	2,722,500	2,696,500
									マネタリーベース	4,029,500	4,014,800	4,008,800	4,009,300	3,983,100
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.044%	▲0.038%	▲0.034%	▲0.040%
									コール市場残高	71,446	79,874	74,510	73,996	67,539
									うち無担	52,074	60,079	54,311	53,923	47,675
									うち有担	19,372	19,795	20,199	20,073	19,864

●入札結果

名称	回数	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)
20年利付国債	157	0.20%	11,000	2016/7/22	2036/6/20	34,652.0	10,010.0	100.8500	0.1550%	69.3548%	101.0200	0.1470%	981.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/7/28	2017/1/27	93,878.0	10,500.05		0.0010%	11.1849%		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
社債等買入	1,000	2016/7/26			2,229	1,000	▲0.304		▲0.252	13.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	66,046	2016/7/20	2016/7/21		863	863		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月21日の予定

*国庫短期証券(622回)入札
(3ヶ月、44,000億円、7/25発行)

*ECB定例理事会(金融政策発表)
*米国6月の中古住宅販売

◆本資料は信頼できるとさ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