Central Daily Market Report

2016年7月22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22日 需給速報		2016年7月25日 需給予想		2016年7月26日 当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 400		1,000	
財政	▲ 11,000		▲ 8,600		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 12,800		▲ 9,000		▲ 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			4,800	▲ 2,700		
国債買現						
国庫短期証買入					15,000	
国債買入			11,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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		▲ 100		▲ 200	1,000	
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	500		100		
当預増減	▲ 12,700		4,300		12,000	
当座預金残高	2,997,700		3,002,000		3,014,000	
準備預金残高	2,700,600					
積み終了先	2,231,600					
超過準備	2,229,600					
非準備預金先	297,100					

7月25日以降の残り所要積立額	
積数	16,300
1日平均	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	99.24%　日数　29.03%

●2016年7月22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8,000億円減の223兆3,000億円(当座預金残高見込みは299兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.03～▲0.025%での調達で始まった。週末であった事から、昨日までと比べ調達ニーズは更に強まり、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、ロール案件の出合いが数件見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/25-7/26)は、▲0.075～▲0.065%程度の出合い。S/N(7/26-7/27)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/Nは、短国買入オペ等の要因があったことから、レートは低下した。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は前日よりやや上昇した。短国買入オペが15,000億円でオファーされた。オファー通知後は一部銘柄で小甘い出合いがみられたものの、応札額は25,000億円程度と予想より少なく、平均利回較差＋0.004%、按分利回較差▲0.012%（按分比率46.2%）としっかりした結果となった。オペ後は3Mで▲0.29%の出合いがみられた。

<CP市場>

CP市場は入札件数・発行額共に少なく総額690億円程度の出合いと閑散。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/22	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.030				－	▲ 0.079
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.072
S/N							－	－
1W			▲ 0.020				－	▲ 0.094
2W			▲ 0.025				－	▲ 0.105
3W							－	▲ 0.115
1M			0.000				－	▲ 0.142
3M							▲ 0.275	▲ 0.195
6M							▲ 0.292	▲ 0.233
1Y							▲ 0.316	▲ 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)
▲ 0.230	0.005	16,627.25	▲ 182.97	105.78-80	106.10-12

日付		7/14	7/15	7/19	7/20	7/21
日銀当預残		3,004,200	3,003,900	2,978,500	2,967,400	3,010,400
準備預金残		2,727,100	2,722,500	2,696,500	2,669,600	2,708,700
マネタリーベース		4,008,800	4,009,300	3,983,100	3,971,800	4,015,800
無担O/N加重平均		▲0.038%	▲0.034%	▲0.040%	▲0.037%	▲0.035%
コール市場残高		74,510	73,996	67,539	71,811	71,278
	うち無担	54,311	53,923	47,675	51,722	51,274
	うち有担	20,199	20,073	19,864	20,089	20,004

●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)
流動性供給	218	－	5,000	2016/7/26	－	13,302.0	4,995.00		▲0.0070%	92.6829%		▲0.0100%	

●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	15,000	2016/7/26			25,554	15,001	▲0.012		0.004	46.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	49,772	2016/7/22	2016/7/25		123	123		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月25日の予定

*月例経済報告
*5月の景気動向指数改訂状況
*6月の貿易統計

◆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