Central Daily Market Report

2016年7月25日（月）
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25日 需給速報		2016年7月26日 需給予想		2016年7月27日 当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 10,100		▲ 1,400		0	
資金過不足	▲ 10,800		▲ 2,300		▲ 1,000	
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				12,500	
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		▲ 200	1,000			
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	2,200		13,700		11,500	

当座預金残高	2,999,900	3,013,600	3,025,100
準備預金残高	2,710,200		
積み終了先	2,242,600	7月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,242,400	積数	14,400
非準備預金先	289,700	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 99.33%	日数	32.26%

●2016年7月25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9,000億円増の224兆2,000億円(当座預金残高見込みは300兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.04～▲0.03%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られるなか、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/26-7/27)は、▲0.09～▲0.08%程度の出合い。S/N(7/27-7/28)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/Nは、国債買入オペ等の要因があったことから、資金調達ニーズが減退しレートはやや低下した。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>

短国市場は全般的に閑散な中、3Mで▲0.29%の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

CP市場は機械、商社、小売業態等からまとまった発行が見られ、発行総額は1,400億円程度に膨らんだ。発行レートは残高が積み上がっている銘柄で、僅かに上昇するものも見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/7/25	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	▲ 0.100	0.001	▲ 0.033				－	▲ 0.081
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W			▲ 0.020				－	▲ 0.101
2W							－	▲ 0.108
3W							－	▲ 0.118
1M							－	▲ 0.146
3M							▲ 0.274	▲ 0.200
6M							▲ 0.289	▲ 0.234
1Y							▲ 0.302	▲ 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)
▲ 0.244	▲ 0.014	16,620.29	▲ 6.96	106.28-30	106.27-30

日付		7/15	7/19	7/20	7/21	7/22
日銀当預残		3,003,900	2,978,500	2,967,400	3,010,400	2,997,700
準備預金残		2,722,500	2,696,500	2,669,600	2,708,700	2,700,600
マネタリーベース		4,009,300	3,983,100	3,971,800	4,015,800	4,004,900
無担O/N加重平均		▲0.034%	▲0.040%	▲0.037%	▲0.035%	▲0.030%
コール市場残高		73,996	67,539	71,811	71,278	76,492
	うち無担	53,923	47,675	51,722	51,274	56,313
	うち有担	20,073	19,864	20,089	20,004	20,179

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,750	2016/7/27			10,587	3,751	0.002		0.003	95.6
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,400	2016/7/27			11,504	4,405	▲0.012		▲0.009	61.2
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2016/7/27			11,343	4,303	▲0.016		▲0.012	39.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	44,327	2016/7/25	2016/7/26		84	84		▲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	2016/7/25	2016/7/26		237	237		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月26日の予定

*6月の企業向けサービス価格指数
*米国FOMC(1日目)
*米国5月の S&P/ケース・シラー住宅価格指数
*米国6月の新築一戸建て販売件数
*米国7月のCB消費者信頼感指数
*40年利付国債入札（4,000億円、7/28発行）
*交付税特別会計借入（10,500億円、8/4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