Central Daily Market Report

2016年7月26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26日 需給速報		2016年7月27日 需給予想		2016年7月28日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 600		▲ 1,000	
財政	▲ 2,300		▲ 400		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 3,300		▲ 1,000		▲ 6,000	
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	15,000					
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000					
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	12,400		11,600		▲ 6,000	

当座預金残高	3,012,300	3,023,900	3,017,900
準備預金残高	2,707,300		
積み終了先	2,241,400		
超過準備	2,241,000		
非準備預金先	305,000		

7月27日以降の残り所要積立額	
積数	13,000
1日平均	600

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	99.39%	日数 35.48%

●2016年7月26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、前日比変わらずの224兆2,000億円（当座預金残高見込みは301兆4,000億円）。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、一巡後も同水準での出合いが散見されるなか、本日の取引を終えた。また、一部邦銀より試し取りと思われる調達が見られた。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(7/27-7/28)は、▲0.09～▲0.08%程度の出合い。S/N(7/28-7/29)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/Nは資金運用・調達ニーズ共に旺盛であったものの、レート水準は変わりなく、昨日と同水準のレートでの引合いとなった。SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、2Y366、5y125～128、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>

短国市場は様子見姿勢が強く、特段の出合いは見られず、閑散としていた。

<CP市場>

CP市場は月末の前倒し発行から不動産、機械、電力業態等からまとまった発行が見られ、発行総額は1,860億円程度に膨らんだ。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

2016/7/26	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	▲ 0.070	0.010	▲ 0.029				－	▲ 0.084
T/N	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.016				－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W			▲ 0.020				－	▲ 0.103
2W			▲ 0.025				－	▲ 0.109
3W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.024				－	▲ 0.121
1M							－	▲ 0.149
3M							▲ 0.274	▲ 0.206
6M							▲ 0.287	▲ 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)
▲ 0.259	▲ 0.015	16,383.04	▲ 237.25	105.58-60	104.10-11

日付		7/19	7/20	7/21	7/22	7/25
日銀当預残		2,978,500	2,967,400	3,010,400	2,997,700	2,999,900
準備預金残		2,696,500	2,669,600	2,708,700	2,700,600	2,710,200
マネタリーベース		3,983,100	3,971,800	4,015,800	4,004,900	4,007,800
無担O/N加重平均		▲0.040%	▲0.037%	▲0.035%	▲0.030%	▲0.033%
コール市場残高		67,539	71,811	71,278	76,492	72,430
	うち無担	47,675	51,722	51,274	56,313	52,278
	うち有担	19,864	20,089	20,004	20,179	20,152

●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)
40年利付国債	9	0.40%	4,000	2016/7/28	2056/3/20	11,559.0	3,995.0	102.0400	0.3450%	31.7647%			
交付税特会	－	－	10,500	2016/8/4	2017/2/3	83,699.0	10,500.03		0.0010%	12.5451%		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
CP等買入	3,500	2016/7/29			7,505	3,479	▲0.001		▲0.001	68.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	65,330	2016/7/26	2016/7/27		280	280		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/7/28	2016/8/4	0.87	130	130				

●2016年7月27日の予定

*米国FOMC(2日目)
*米国6月の耐久財新規受注
*英国4-6月期のGDP速報値

◆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