Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

● 貸金需給							
¥ /4 / 4 m	2016年	7月27日	2016年	7月28日	2016年7月29日		
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		▲ 600	4	1, 200	1 ,000		
財政		▲ 600	4	3, 500		25, 500	
資金過不足	4	1, 200	4	4, 700	24, 500		
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							
国債買入	12, 700				7, 500		
CP等買入		4 00		▲ 100	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				▲ 100			
ETF買入							
国債補完供給	▲ 200	300		200			
当預増減		11, 200		4, 700		35, 500	
当座預金残高	3,	023, 500	3,	018, 800	3, 054, 300		
準備預金残高	2,	720, 800					
積み終了先		257, 500		7月28日以	降の残り所要積立額		
超過準備		257, 500		積数	11, 900		
非準備預金先		302, 700		1日平均	600		
積み期間 (7/16~	8/15) <i>o</i> .)所要準	備額		2, 136, 900		
準備預金進捗率	実績		99. 44%	日数	38. 71%		

●2016年7月27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2兆円増の226兆2,000億円(当座預金残高見込みは302兆4,000億円)。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、ロール案件の出合いが数件見られた。

〈レポ市場〉

GC T/N(7/28-7/29)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(7/29-8/1)は、▲0.12~▲0.11%程度の出合い。S/Nは月末初の受渡しにあたり、資金調達サイドのニーズが減退したことから、レートは低下。▲0.10%を下回って推移し、出合い量も限られたものとなった。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〉

短国市場は売り物が薄い中、3Mで▲0.30%の出合いが見られた程度で全般的に閑散だった。

〈CP市場〉

CP市場は、月末発行となり鉄鋼、機械、不動産、石油業態等からまとまった発行が見られ、発行総額は6,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

2016/7/27	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	売買参考統計值	平均値
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.028				_	▲ 0.085
T/N	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.089
S/N							_	_
1W	▲ 0.020	▲ 0.003	▲ 0.014				_	▲ 0.108
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.115
3W			0.000				-	▲ 0.126
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.013				_	▲ 0.153
3M							▲ 0.276	▲ 0.206
6M							▲ 0.289	▲ 0.234
1Y							▲ 0.305	▲ 0.235

直記	丘値	前日比		15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)		
A 0	0.298	A (0.039	16	16,664.82		281.78		104.84-87	105.39-41		
日付			7/2	0 7/21			7/22		7/25	7/26		
日銀当	日銀当預残		2,967	400 3,010,4		00	2,997,700		2,999,900	3,012,300		
準備預金残		2,669,600		2,708,700		2,700,600		2,710,200	2,707,300			
マネタ	マネタリーベース		3,971,800		4,015,800		4,004,900		4,007,800	4,021,200		
無担O	無担O/N加重平均		▲0.037%		▲0.035%		▲0.030%		6 ▲0.033%	▲0.029%		
コール	コール市場残高		71,811		71,278		76,492		72,430	76,795		
	う ‡	ち無担	51,722		51,2	51,274		1:	52,278	57,022		
	51	ち有担	20,	089	20,0	04	20,179		20,152	19,773		

日経平均株価

ドル/円

●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

O 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1										
禮類	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5年超10年以下)	4,300	2016/7/29			10,233	4,306	▲0.035		▲0.032	95.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/7/29			5,429	2,002	▲0.043		▲0.037	65.3
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/7/29			3,705	1,203	▲0.055		▲0.050	52.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,675	2016/7/27	2016/7/28		207	207		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月28日の予定

*日銀銀政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、29日まで) *国庫短期証券(623回)入札 (3ヶ月、44,000億円、8/1発行) *2年利付国債入札

(23,000億円、8/15発行)

*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/9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さお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。

可以に盛りるの滅びする音画で日神元音をよいがわれている。 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