Central Daily Market Report

2016年7月28日（木）
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28日 需給速報		2016年7月29日 需給予想		2016年8月1日 当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 800		0	
財政	▲ 3,700		2,000		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 5,000		1,200		▲ 16,000	
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					5,100	▲ 4,000
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,400			
CP等買入		▲ 100	3,500	▲ 2,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 5,200		10,800		▲ 14,900	

当座預金残高	3,018,300	3,029,100	3,014,200
準備預金残高	2,704,700		
積み終了先	2,245,700	7月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,245,700	積数	10,800
非準備預金先	313,600	1日平均	600
積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			2,136,900
準備預金進捗率	実績 99.49%	日数	41.94%

●2016年7月28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1兆7,000億円減の224兆5,000億円(当座預金残高見込みは301兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.035～▲0.025%での調達で始まった。引き続き調達ニーズの強い状態で始まったものの、一巡後はビッドレートがやや低下し散発的に出合う程度で、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(7/29-8/1)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/N(8/1-8/2)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。S/Nは国庫短期証券の発行日にあたることから、昨日の水準からレートを上げての出合いとなった。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3M物の入札が実施された。政策決定会合での追加緩和の可能性が予想される中、WI取引での▲0.305%で出合いを受け、平均落札利回▲0.2933%、按分利回▲0.2745%と堅調な結果となった。セカンダリー市場では▲0.30%近辺で推移した。

<CP市場>

CP市場は、月初発行にあたったものの、化学、商社、石油業態等から幅広い発行が見られ、発行総額は3,300億円程度に達した。発行レートは、僅かに上昇する銘柄も散見されたが、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/28	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	0.001	▲ 0.031				－	▲ 0.088
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.093
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.104
2W							－	▲ 0.109
3W							－	▲ 0.126
1M							－	▲ 0.156
3M							▲ 0.302	▲ 0.205
6M							▲ 0.291	▲ 0.234
1Y							▲ 0.305	▲ 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)
▲ 0.280	0.018	16,476.84	▲ 187.98	104.90-92	104.68-70

日付		7/21	7/22	7/25	7/26	7/27
日銀当預残		3,010,400	2,997,700	2,999,900	3,012,300	3,023,500
準備預金残		2,708,700	2,700,600	2,710,200	2,707,300	2,720,800
マネタリーベース		4,015,800	4,004,900	4,007,800	4,021,200	4,033,000
無担O/N加重平均		▲0.035%	▲0.030%	▲0.033%	▲0.029%	▲0.028%
コール市場残高		71,278	76,492	72,430	76,795	80,999
	うち無担	51,274	56,313	52,278	57,022	61,124
	うち有担	20,004	20,179	20,152	19,773	19,875

●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)
国庫短期証券	623	－	43,500	2016/8/1	2016/10/31	147,131.0	39,584.7	100.0685	▲0.2745%	51.0172%	100.0732	▲0.2933%	3,915.0
2年利付国債	367	0.10%	23,000	2016/8/15	2018/8/15	84,673.0	21,459.0	100.8700	▲0.3320%	29.0642%	100.9300	▲0.3610%	1,540.0
交付税特会	－	－	10,500	2016/8/9	2017/2/9	89,019.0	10,500.03		0.0010%	11.7954%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/8/1	2016/8/15		5,100	5,100				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	30,000	2016/7/28	2016/7/29		220	220		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月29日の予定

*日銀政策委員会・金融融政策決定会合（2日目、終了後直ちに結果公表）
*黒田日銀総裁、定例会見　*経済・物価情勢の展望
*6月の全国・7月都区部消費者物価指数(CPI)
　市場予想：全　　国(6月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%
　　：東京都区部(7月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.5%
*6月の完全失業率(市場予想：3.2%)　*6月の有効求人倍率(市場予想：1.37倍)
*6月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲0.3%)
*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比＋0.7%)
*6月の商業動態統計速報
*6月の住宅着工統計
*米国4-6月期のGDP速報値
*米国7月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏4-6月期のGDP速報値
*ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値

◆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