

Central Daily Market Report

2016年7月29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29日		2016年8月1日		2016年8月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		1,000		2,000	
財政	1,300		▲ 20,900		▲ 5,000	
資金過不足	500		▲ 19,900		▲ 3,000	
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	3,500	▲ 2,300		▲ 100		
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				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
当預増減	9,600		▲ 18,400		▲ 3,000	
当座預金残高	3,027,900		3,009,500		3,006,500	
準備預金残高	2,713,700					
積み終了先	2,255,300		8月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,255,300		積数		7,900	
非準備預金先	314,200		1日平均		500	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,139,400	
準備預金進捗率	実績	99.63%	日数	51.61%		

●2016年7月29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1兆3,000億円増の225兆8,000億円(当座預金残高見込みは302兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.07~▲0.03%での調達で始まった。月末要因に加え、金融政策決定会合の結果を控えて積極的な調達を見合わせた先も見られことから、幅広いレンジでの出会いとなった。午後は、目立った出会いは見られず、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/1-8/2)は、▲0.08~▲0.07%程度のお合い。S/N(8/2-8/3)は、▲0.09~▲0.08%程度のお合い。S/Nは金融政策決定会合の追加緩和による影響はほとんど無く、レート水準をやや下げたものの、落ち着いて推移した。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、30Y48~51などにビットの出入りが多く見られた。

<短国市場>

短国市場は決定会合前に3Mで▲0.30%のお合いが見られた程度であった。決定会合後は一旦▲0.225%まで売られたものの、引け際には▲0.25%まで値を戻した。

<CP市場>

CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額600億円程度のお合いと閑散。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

2016/7/29	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.088	▲ 0.180	0.100	16,569.27	92.43	104.79-83	103.61-64
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.108						
2W			0.000				-	▲ 0.118						
3W							-	▲ 0.141						
1M							-	▲ 0.167						
3M							▲ 0.271	▲ 0.215						
6M							▲ 0.260	▲ 0.243						
1Y							▲ 0.273	▲ 0.249						
									日付	7/22	7/25	7/26	7/27	7/28
									日銀当預残	2,997,700	2,999,900	3,012,300	3,023,500	3,018,300
									準備預金残	2,700,600	2,710,200	2,707,300	2,720,800	2,704,700
									マネタリーベース	4,004,900	4,007,800	4,021,200	4,033,000	4,029,200
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.033%	▲0.029%	▲0.028%	▲0.031%
									コール市場残高	76,492	72,430	76,795	80,999	82,437
									うち無担	56,313	52,278	57,022	61,124	63,144
									うち有担	20,179	20,152	19,773	19,875	19,293

●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1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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,716	2016/7/29	2016/8/1		375	375		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	24,747	2016/7/29	2016/8/1		97	97		▲0.500	▲0.500	

●2016年8月1日の予定

*米国6月の建設支出

*米国7月のISM製造業景況指数

●日銀金融政策決定会合・結果

●金融緩和の強化として、以下の措置を決定。

(1) ETF買入れ額の増額(賛成7反対2)

ETFについて、保有残高が年間約6兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う(現行の約3.3兆円からほぼ倍増)。

(2) 企業・金融機関の外貨資金調達環境の安定のための措置(全員一致)

①成長支援資金供給・米ドル特則の拡大

成長支援資金供給・米ドル特則(企業の海外展開を支援する為、最長4年の米ドル資金を金融機関経由で供給する制度)の総枠を240億ドル(約2.5兆円)に拡大する(現行の120億ドルから倍増)。

②米ドル資金供給オペの担保となる国債の貸付け制度の新設

金融機関に対する米ドル資金供給オペに関し、担保となる国債を、日本銀行当座預金を見合いとして貸し付ける制度を新設する。

●金融市場調節方針、ETF以外の資産買入れ方針、政策金利については、現行の方針を維持することを賛成多数で決定。

◆本資料は信頼できるとさ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録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