Central Daily Market Report

2016年7月5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5日 需給速報		2016年7月6日 需給予想		2016年7月7日 当社予想	
銀行券	1,000		500		0	
財政	9,400		▲ 1,500		▲ 28,000	
資金過不足	10,400		▲ 1,000		▲ 28,000	
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	100	▲ 600				
国債買現						
国庫短期証買入	20,000					
国債買入	12,700		4,400			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
ＥＴＦ買入	100		300			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	42,500		3,400		▲ 28,000	

当座預金残高	3,050,200	3,053,600	3,025,600
準備預金残高	2,746,100		
積み終了先	2,270,800		
超過準備	2,270,800		
非準備預金先	304,100		

7月6日以降の残り所要積立額	
積数	1,000
1日平均	100

積み期間（6/16～7/15）の所要準備額			2,064,300
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数 66.67%

●2016年7月5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3兆1,000億円増加の227兆円(当座預金残高見込みは304兆9,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託より▲0.065%近辺の調達希望で始まった。本日も調達ニーズは強く、立ち上がりは0.06%の出合い。一巡後は▲0.07～▲0.04%で幅広いレンジでの出合いが散見された。ターム物は証券業態のロール案件が見られた程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/6-7/7)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(7/7-7/8)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。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、5Y128、10Y338～343、20Y155～156、30Y48～51、40Y9などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は1Y物で▲0.32%で少額の出合いが見られた程度と閑散だった。

<CP市場>

発行市場は償還総額500億円程度に対し、発行件数少なく、発行総額は200億円程度と閑散だった。発行レートは低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/7/5	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	▲ 0.078	▲ 0.005	▲ 0.054				－	▲ 0.083
T/N			▲ 0.040				－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				－	▲ 0.096
2W							－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.106
1M							－	▲ 0.115
3M							▲ 0.327	▲ 0.209
6M							▲ 0.284	▲ 0.230
1Y							▲ 0.314	▲ 0.231

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)
▲ 0.255	0.000	15,669.33	▲ 106.47	102.50-52	101.73-75

日付	6/28	6/29	6/30	7/1	7/4
日銀当預残	3,032,300	3,036,300	3,032,800	3,042,800	3,007,700
準備預金残	2,739,000	2,740,300	2,725,900	2,725,600	2,714,100
マネタリーベース	4,037,200	4,042,400	4,039,400	4,050,300	4,014,400
無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.061%	▲0.064%	▲0.058%	▲0.057%
コール市場残高	66,789	68,734	58,667	77,486	69,151
うち無担	45,835	48,776	43,033	57,069	49,124
うち有担	20,954	19,958	15,634	20,417	20,027

●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)
10年利付国債	343	0.10%	24,000	2016/7/7	2026/6/20	79,297.0	21,804.0	103.4700	▲0.2400%	29.3387%	103.5000	▲0.2430%	2,180.0

●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）	32,107	2016/7/5	2016/7/6		99	99		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2016/7/5	2016/7/6		20	20		▲0.600	▲0.600	

●2016年7月6日の予定

*国庫短期証券(618回)入札
（6ヶ月、35,000億円、7/11発行）

*交付税特別会計借入
（10,500億円、7/15借入）

*米国5月の貿易収支
*米国6月のISM製造業景況指数

◆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