

# Central Daily Market Report

2016年7月6日(水)

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6日		2016年7月7日		2016年7月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400	▲ 300	▲ 1,000			
財政	▲ 1,100	▲ 22,200	3,000			
資金過不足	▲ 700	▲ 22,500	2,000			
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						
国債買入	4,400				12,700	
CP等買入		▲ 400	▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 100	100	100			
当預増減	3,600	▲ 22,600	14,200			
当座預金残高	3,053,800	3,031,200	3,045,400			
準備預金残高	2,754,300					
積み終了先	2,278,000			7月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,277,800			積数	600	
非準備預金先	299,500			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	99.97%	日数	70.00%		

## ●2016年7月6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9,000億円増加の227兆9,000億円(当座預金残高見込みは305兆4,000億円)。朝方の無担O/N物は都銀・信託より▲0.06%近辺の調達希望で始まった。引き続き調達ニーズは強く、テイクンで寄り付き▲0.055%の出会い。一巡後は▲0.06~▲0.04%の出会いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は証券業態のロール案件が散見された程度であった。共通担保資金供給オペアは、3M物で8,000億円オフアされ、応札額50億円(期落ち額550億円)で札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(7/7-7/8)は、▲0.09~▲0.085%程度の出会い。S/N(7/8-7/11)は、▲0.09~▲0.08%程度の出会い。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、20Y155~157、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6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.35%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.3939%、按分落札利回▲0.3722%と平均・按分共に過去最低レートを更新する強い入札となった。セカンダリーは▲0.50%と▲0.45%で小額の出合いが見られた程度と小動きだった。

### <CP市場>

発行市場は償還総額600億円程度に対し、10日に係る発行から鉄鋼、機械、商社業態でまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,100億円程度とやや膨らんだ。発行レートは一部上昇する銘柄が見られたが、全体としては概ね横ばいの推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/7/6	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	▲ 0.100	▲ 0.020	▲ 0.056				-	▲ 0.085	▲ 0.275	▲ 0.020	15,378.99	▲ 290.34	101.15-17	100.97-99
T/N	▲ 0.040	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.097						
2W			0.010				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.106						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.327	▲ 0.215						
6M							▲ 0.450	▲ 0.231						
1Y							▲ 0.315	▲ 0.233						
									日付	6/29	6/30	7/1	7/4	7/5
									日銀当預残	3,036,300	3,032,800	3,042,800	3,007,700	3,050,200
									準備預金残	2,740,300	2,725,900	2,725,600	2,714,100	2,746,100
									マネタリーベース	4,042,400	4,039,400	4,050,300	4,014,400	4,055,900
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.064%	▲0.058%	▲0.057%	▲0.054%
									コール市場残高	68,734	58,667	77,486	69,151	75,042
									うち無担	48,776	43,033	57,069	49,124	54,982
									うち有担	19,958	15,634	20,417	20,027	20,060

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	618	-	35,000	2016/7/11	2017/1/11	140,195.0	31,859.8	100.1880	▲0.3722%	44.7922%	100.1990	▲0.3939%	3,140.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/7/15	2017/1/13	94,784.0	10,500.09		0.0010%	11.0780%		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>	15,000	2016/7/8	2016/10/18		50	50				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2016/7/8			10,960	3,751	▲0.011		▲0.008	96.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/7/8			8,069	4,402	▲0.015		▲0.012	38.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2016/7/8			7,364	4,302	▲0.037		▲0.023	44.2
国債買入(物価連動債)	250	2016/7/8			1,938	251	▲1.100		▲1.200	7.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,000	2016/7/6	2016/7/7		73	73		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/7/8	2016/7/14	0.89	220	220				

## ●2016年7月7日の予定

- \*日銀銀支店長会議 さくらレポート(=地域経済報告)
- \*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*5月の景気動向指数速報
- \*国庫短期証券(619回)入札 (3か月、44,000億円、7/11発行)
- \*流動性供給入札 (2,000億円、7/11発行)

◆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いております。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