Central Daily Market Report

2016年7月21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21日 需給速報		2016年7月22日 需給予想		2016年7月25日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,800		0	
財政	500		▲ 11,000		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 500		▲ 12,800		▲ 9,000	
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					4,800	▲ 2,700
国債買現						
国庫短期証買入	35,100					
国債買入	4,700				11,400	
CP等買入	3,500	▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			1,100	▲ 1,100		
社債等買入				▲ 100		
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 500	900		500		
当預増減	43,000		▲ 12,600		4,500	

当座預金残高	3,010,400	2,997,800	3,002,300
準備預金残高	2,708,700		
積み終了先	2,233,000		
超過準備	2,230,400		
非準備預金先	301,700		

7月22日以降の残り所要積立額	
積数	27,700
1日平均	1,100

積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			2,137,000
準備預金進捗率	実績	98.70%	日数 19.35%

●2016年7月21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3兆1,000億円増の224兆1,000億円(当座預金残高見込みは301兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.04～▲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調達希望が続いたが、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(7/22-7/25)は、▲0.085～▲0.075%程度の出合い。S/N(7/25-7/26)は、▲0.060～▲0.065%程度の出合い。S/Nは、短国発行等の要因があったことから、レートは上昇した。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、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>

現先レートT/Nは低水準で推移。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。買い手が限定されている中、レート上昇が期待されていたものの、WI取引で▲0.295～▲0.29%の出合いが見られたこともあり、平均落札利回は▲0.2685%と上昇したものの、按分落札利回り▲0.2505%（按分比率57.7784%）と前回とほぼ横ばいの水準にとどまった。セカンダリーでは▲0.285%と堅調な出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は25日発行となり電機、鉄鋼、自動車業態等からまとまった発行が見られ総額1,900億円程度に達した。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

2016/7/21	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.035				－	▲ 0.080
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.078
S/N							－	－
1W			▲ 0.020				－	▲ 0.093
2W	▲ 0.038	▲ 0.030	▲ 0.034				－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.111
1M	▲ 0.040	0.000	▲ 0.036				－	▲ 0.138
3M							▲ 0.274	▲ 0.192
6M							▲ 0.300	▲ 0.233
1Y							▲ 0.335	▲ 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)
▲ 0.235	0.008	16,810.22	128.33	107.17-20	106.82-84

日付		7/13	7/14	7/15	7/19	7/20
日銀当預残		3,010,900	3,004,200	3,003,900	2,978,500	2,967,400
準備預金残		2,731,800	2,727,100	2,722,500	2,696,500	2,669,600
マネタリーベース		4,014,800	4,008,800	4,009,300	3,983,100	3,971,800
無担O/N加重平均		▲0.044%	▲0.038%	▲0.034%	▲0.040%	▲0.037%
コール市場残高		79,874	74,510	73,996	67,539	71,811
	うち無担	60,079	54,311	53,923	47,675	51,722
	うち有担	19,795	20,199	20,073	19,864	20,089

●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	622	－	43,500	2016/7/25	2016/10/24	167,699.0	39,603.7	100.0625	▲0.2505%	57.7784%	100.0670	▲0.2685%	3,896.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/7/25	2016/8/8		4,790	4,790				
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,750	2016/7/25			11,897	3,753	0.002		0.003	58.2
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,400	2016/7/25			7,869	4,401	▲0.004		0.000	56.1
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,000	2016/7/25			3,991	2,003	0.016		0.022	3.1
国債買入（残存期間25年超）	1,200	2016/7/25			3,871	1,202	0.030		0.032	96.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	35,465	2016/7/21	2016/7/22		469	469		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月22日の予定

*流動性供給入札
（5,000億円、7/26発行）

◆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