

# Central Daily Market Report

2016年6月1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6月1日 |          | 2016年6月2日 |        | 2016年6月3日      |           |
|-----------------------|-----------|----------|-----------|--------|----------------|-----------|
|                       | 需給速報      | 需給予想     | 需給速報      | 需給予想   | 当社予想           | 当社予想      |
| 銀行券                   | 600       | 100      |           |        |                | 0         |
| 財政                    | ▲ 15,500  | ▲ 49,000 |           |        |                | 3,000     |
| 資金過不足                 | ▲ 14,900  | ▲ 48,900 |           |        |                | 3,000     |
| <b>金融調節</b>           |           |          |           |        |                |           |
|                       | 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                  |           |          |           |        |                |           |
| 国債買現                  |           |          |           |        |                |           |
| 国庫短期証買入               |           |          |           |        |                |           |
| 国債買入                  | 12,800    |          |           |        | 4,300          |           |
| CP等買入                 |           |          |           | ▲ 200  |                |           |
| 貸出支援基金(成)             |           |          |           |        | 6,900          | ▲ 2,200   |
| 貸出支援基金(貸)             |           |          |           |        |                |           |
| 被災地支援                 |           |          |           |        |                |           |
| 社債等買入                 |           |          |           |        |                |           |
| ETF買入                 |           |          |           |        |                |           |
| 国債補完供給                |           | 400      |           |        |                |           |
| 当増増減                  | ▲ 1,700   |          | ▲ 49,100  |        |                | 12,000    |
| 当座預金残高                | 2,866,200 |          | 2,817,100 |        |                | 2,829,100 |
| 準備預金残高                | 2,591,800 |          |           |        |                |           |
| 積み終了先                 | 2,143,300 |          |           |        | 6月2日以降の残り所要積立額 |           |
| 超過準備                  | 2,143,300 |          |           |        | 積数             | 7,400     |
| 非準備預金先                | 274,400   |          |           |        | 1日平均           | 500       |
| 積み期間(5/16~6/15)の所要準備額 |           |          |           |        |                | 2,129,200 |
| 準備預金進捗率               | 実績        | 99.65%   | 日数        | 54.84% |                |           |

## ●2016年6月1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6,000億円増加の214兆6,000億円(当座預金残高見込みは286兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.04%のオファーに対し、▲0.05%のビッドで始まった。その後は邦銀、証券から昨日と同水準の▲0.08~▲0.03%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は、▲0.07%近辺の調整程度の出合いが散見された。ターム物は、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いがまばらに見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(6/2-6/3)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(6/3-6/6)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。SC個別銘柄では10Y336~342、30Y48~50、40Y8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S/Nは下限域で推移。短国市場は引続き全般的に閑散な中、1Yが▲0.415%で少額の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは下限域で推移。CP市場はノンバンク業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,150億円程度に達した。発行レートは引続き低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/6/1 | 無担(速報)  |       |         | 有担(速報) |    |    | 短国<br>売買参考統計値 | 東京<br>レポレート<br>平均値 | 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      | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.054 |        |    |    | -             | ▲ 0.084            | ▲ 0.120   | 0.000     | 16,955.73 | ▲ 279.25  | 110.63-65 | 110.05-06 |
| T/N      |         |       | ▲ 0.015 |        |    |    | -             | ▲ 0.087            |           |           |           |           |           |           |
| S/N      |         |       |         |        |    |    | -             | -                  |           |           |           |           |           |           |
| 1W       |         |       | 0.000   |        |    |    | -             | ▲ 0.099            |           |           |           |           |           |           |
| 2W       | ▲ 0.030 | 0.001 | ▲ 0.028 |        |    |    | -             | ▲ 0.105            |           |           |           |           |           |           |
| 3W       |         |       |         |        |    |    | -             | ▲ 0.115            |           |           |           |           |           |           |
| 1M       |         |       | ▲ 0.030 |        |    |    | -             | ▲ 0.147            |           |           |           |           |           |           |
| 3M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.284       | ▲ 0.202            |           |           |           |           |           |           |
| 6M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.304       | ▲ 0.215            |           |           |           |           |           |           |
| 1Y       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.395       | ▲ 0.221            |           |           |           |           |           |           |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | 日付        | 5/25      | 5/26      | 5/27      | 5/30      | 5/31      |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | 日銀当預残     | 2,830,600 | 2,837,000 | 2,849,100 | 2,846,800 | 2,867,900 |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | 準備預金残     | 2,554,500 | 2,555,800 | 2,563,800 | 2,579,000 | 2,577,300 |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | マネタリーベース  | 3,829,500 | 3,836,800 | 3,850,000 | 3,847,100 | 3,867,300 |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | 無担O/N加重平均 | ▲0.055%   | ▲0.054%   | ▲0.049%   | ▲0.054%   | ▲0.054%   |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | コール市場残高   | 64,091    | 68,083    | 72,789    | 65,615    | 53,810    |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | うち無担      | 47,423    | 50,895    | 55,314    | 49,372    | 39,775    |
|          |         |       |         |        |    |    |               |                    | うち有担      | 16,668    | 17,188    | 17,475    | 16,243    | 14,035    |

## ●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 | 素分率      | 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) |
|-------|----|------|--------|-----------|-----------|----------|-----------|-------|-------------|----------|--------|-------------|---------------|
| 交付税特会 | -  | -    | 10,500 | 2016/6/10 | 2016/12/9 | 60,675.0 | 10,500.03 |       | 0.0010%     | 17.3055% |        | 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 |
|---------------------------|----------------|----------|----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債買入(残存期間1年以下)            | 700            | 2016/6/3 |          |      | 2,862         | 704           | 0.000           |                 | 0.013             | 71.0 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下)       | 2,200          | 2016/6/3 |          |      | 7,345         | 2,202         | 0.017           |                 | 0.021             | 47.4 |
| 国債買入(残存期間25年超)            | 1,400          | 2016/6/3 |          |      | 5,477         | 1,402         | 0.033           |                 | 0.037             | 40.4 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 19,554         | 2016/6/1 | 2016/6/2 |      | 21            | 21            |                 | ▲0.600          | ▲0.600            |      |
| 米ドル資金供給                   |                | 2016/6/3 | 2016/6/9 | 0.85 | 0             | 0             |                 |                 |                   |      |

## ●2016年6月2日の予定

|                              |                   |   |
|------------------------------|-------------------|---|
| *佐藤日銀審議委員、<br>釧路市金融経済懇談会にて講演 | *ECB定例理事会(金融政策発表) | *国庫短期証券(611回)入札<br>(3ヶ月、44,000億円、6/6発行) |
| *5月のマネタリーベース                 |                   | *10年利付国債入札<br>(24,000億円、6/20発行)         |
| *5月の消費動向調査                   |                   |   |
| *5月実績/6月見込み財政資金対民間収支         |                   |   |

◆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