

Central Daily Market Report

2016年6月3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6月3日		2016年6月6日		2016年6月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		1,500		1,000	
財政	6,700		▲1,400		1,000	
資金過不足	7,100		100		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			3,400	▲5,800		
国債買現						
国庫短期証券買入					10,000	
国債買入	4,500				12,400	
CP等買入		▲100		▲1,600		
貸出支援基金(成)	6,900	▲3,900		▲100		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲200			200		
当預増減	14,300		▲3,800		24,400	
当座預金残高	2,831,200		2,827,400		2,851,800	
準備預金残高	2,560,500					
積み終了先	2,116,800				6月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,116,200				積数	3,400
非準備預金先	270,700				1日平均	300
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	99.84%	日数	67.74%		

●2016年6月3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1兆8,000億円増加の211兆3,000億円(当座預金残高見込みは283兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態を中心に▲0.07~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後は▲0.08~▲0.03%での出会いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件を中心にショートタームでの出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/6-6/7)は、▲0.07~▲0.065%程度のお合い。S/N(6/7-6/8)は、▲0.085~▲0.08%程度のお合い。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。短国市場は短国買入オペアが10,000億円で実施され、平均利回較差+0.004%、按分利回較差±0.000%と、引け値の低い1Yを中心に応札されたと見られる小甘い結果となった。その他は3Mで▲0.26~▲0.258%のお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、機械、商社によるまとまった発行が見られたものの、発行総額は800億円程度のお合いにとどまった。発行レートは引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/6/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 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	0.010	▲0.046				-	▲0.079	▲0.105	▲0.005	16,642.23	79.68	108.86-88	108.74-76
T/N							-	▲0.072						
S/N							-	-						
1W			▲0.025				-	▲0.097						
2W							-	▲0.104						
3W			0.000				-	▲0.114						
1M							-	▲0.150						
3M							▲0.255	▲0.197						
6M							▲0.281	▲0.214						
1Y							▲0.378	▲0.220						
									日付	5/27	5/30	5/31	6/1	6/2
									日銀当預残	2,849,100	2,846,800	2,867,900	2,866,200	2,816,900
									準備預金残	2,563,800	2,579,000	2,577,300	2,591,800	2,542,800
									マネタリーベース	3,850,000	3,847,100	3,867,300	3,865,000	3,815,500
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.055%
									コール市場残高	72,789	65,615	53,810	69,426	72,656
									うち無担	55,314	49,372	39,775	52,129	56,274
									うち有担	17,475	16,243	14,035	17,297	16,382

●入札結果

名称	回数	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	棄分率	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
国庫短期証券買入	10,000	2016/6/7			26,919	10,004	0.000		0.004	23.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/6/7			13,780	3,508	0.005		0.007	21.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/6/7			15,428	4,408	▲0.002		▲0.001	87.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/6/7			10,203	4,510	▲0.004		▲0.003	55.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	14,257	2016/6/3	2016/6/6		200	200		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2016/6/3	2016/6/6		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月6日の予定

*5月のFRB労働市場情勢指数

◆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