

# Central Daily Market Report

2016年6月7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6月7日		2016年6月8日		2016年6月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		600		▲1,000	
財政	4,400		1,800		▲2,000	
資金過不足	5,600		2,400		▲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	10,000					
国債買入	12,800					
CP等買入		▲400		▲100	4,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲200		▲100		
E T F買入	400		400			
国債補完供給	▲100			100		
当増減	28,100		2,700		1,500	
当座預金残高	2,855,400		2,858,100		2,859,600	
準備預金残高	2,571,500					
積み終了先	2,129,900			6月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,129,900			積数	2,100	
非準備預金先	283,900			1日平均	300	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,141,100	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	74.19%		

## ●2016年6月7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2兆6,000億円増加の213兆3,000億円(当座預金残高見込みは285兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後は▲0.07~▲0.025%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(6/8-6/9)は、▲0.095~▲0.09%程度のお合い。S/N(6/9-6/10)は、▲0.10~▲0.095%程度のお合い。T/N・S/Nとも、目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内での取引となった。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10Y336~342、30Y48~50、40Y8~9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は下限域での推移となった。アウトライト市場は、総じて動意に乏しい中、3M▲0.25%での取引が見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは下限域での推移となった。CP発行市場は、商社・石油・小売業態等からの大型発行案件が実施されたため、200億円強の償還に対して、1,200億円強の発行と、やや膨らんだ。発行レートは、引き続き0%近辺での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/6/7	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	▲0.080	0.001	▲0.049				-	▲0.085	▲0.125	0.000	16,675.45	95.42	107.45-47	107.73-75
T/N			0.000				-	▲0.095						
S/N							-	-						
1W	▲0.050	0.010	▲0.013				-	▲0.099						
2W	▲0.030	0.230	▲0.006				-	▲0.105						
3W							-	▲0.115						
1M							-	▲0.156						
3M							▲0.255	▲0.190						
6M							▲0.266	▲0.214						
1Y							▲0.354	▲0.220						
									日付	5/31	6/1	6/2	6/3	6/6
									日銀当預残	2,867,900	2,866,200	2,816,900	2,831,200	2,827,300
									準備預金残	2,577,300	2,591,800	2,542,800	2,560,500	2,556,100
									マネタリーベース	3,867,300	3,865,000	3,815,500	3,829,400	3,824,000
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.054%	▲0.055%	▲0.046%	▲0.050%
									コール市場残高	53,810	69,426	72,656	73,488	71,886
									うち無担	39,775	52,129	56,274	56,109	53,292
									うち有担	14,035	17,297	16,382	17,379	18,594

## ●入札結果

名称	回数	表面利率	発行予定額(億円)	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	棄分率	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)
30年利付国債	51	0.30%	8,000	2016/6/20	2046/6/20	24,908.0	7,279.00	99.4500	0.3200%	87.1794%	99.5900	0.3140%	712.0

## ●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)	18,995	2016/6/7	2016/6/8		73	73		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	11,438	2016/6/7	2016/6/8		15	15		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/6/9	2016/6/16	0.85	1	1				

## ●2016年6月8日の予定

- \*1-3月期のGDP2次速報(市場予想：前期比年率+1.9%)
- \*4月の特定サービス産業動態統計速報
- \*4月の国際収支
- \*5月の景気ウォッチャー調査
- \*国庫短期証券(612回)入札(35,000億円、6/10発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、6/17借入)

◆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