

Central Daily Market Report

2016年6月9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6月9日		2016年6月10日		2016年6月13日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	0	0	0	0	0	0	
財政	▲ 2,800	▲ 8,200	▲ 8,200	▲ 8,200	1,000	1,000	
資金過不足	▲ 2,800	▲ 8,200	▲ 8,200	▲ 8,200	1,000	1,000	
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						2,100	▲ 2,500
国債買現							
国庫短期証買入							
国債買入			9,600				
CP等買入	4,500			▲ 1,000			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援							
社債等買入				▲ 100			
ETF買入			400				
国債補完供給		200					
当預増減	1,900		700		600		
当座預金残高	2,856,500		2,857,200		2,857,800		
準備預金残高	2,570,500						
積み終了先	2,131,000						6月10日以降の残り所要積立額
超過準備	2,131,000						積数 1,000
非準備預金先	286,000						1日平均 200
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	99.95%	日数	80.65%			

●2016年6月9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5,000億円減少の212兆9,000億円(当座預金残高見込みは285兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心にして▲0.07~▲0.03%近辺での調達で始まり、一巡後は▲0.07~▲0.025%の出会い水準で推移した。午後は閑散としたまま本日の取引を終了した。ターム物は、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(6/10-6/13)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(6/13-6/14)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N・S/Nとも、短国発行等の要因があったものの、レート上昇は限定的となった。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30Y49・30Y50・40Y8等にビッドの出入りが多く見られ、O/N中心に締まったレベルでの取引となった。

<短国市場>

現先レートS/Nは下限域での推移となった。本日は、3Mの入札が実施された。結果は、平均落札利回▲0.2629%、按分落札利回▲0.2505%と引き続き堅調な水準での決着となった。セカンダリー市場では、3M▲0.262%、6M▲0.385~▲0.373%で出会いが見られた。

<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、800億円強の償還に対して、600億円弱の発行にとどまった。商社業態よりまとまった発行が実施されたものの、発行件数は少なく、閑散としたマーケットであった。発行レートは0%付近となっていた。

●短期金融市場関連指標

2016/6/9	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	売買取引値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.084	▲ 0.130	▲ 0.015	16,668.41	▲ 162.51	106.78-79	106.35-37
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.102						
2W	0.010	0.200	0.019				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.154						
1M							-	▲ 0.170						
3M							▲ 0.266	▲ 0.190						
6M							▲ 0.378	▲ 0.218						
1Y							▲ 0.323	▲ 0.222						
									日付	6/2	6/3	6/6	6/7	6/8
									日銀当預残	2,816,900	2,831,200	2,827,300	2,855,400	2,854,600
									準備預金残	2,542,800	2,560,500	2,556,100	2,571,500	2,567,400
									マネタリーベース	3,815,500	3,829,400	3,824,000	3,851,000	3,849,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.046%	▲ 0.050%	▲ 0.049%	▲ 0.049%
									コール市場残高	72,656	73,488	71,886	72,515	67,941
									うち無担	56,274	56,109	53,292	55,618	51,705
									うち有担	16,382	17,379	18,594	16,897	16,236

●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	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)
国庫短期証券	613	-	43,600	2016/6/13	2016/9/12	153,438.0	39,675.7	100.0625	▲ 0.2505%	65.8362%	100.0656	▲ 0.2629%	3,924.0
5年利付国債	128	0.10%	24,000	2016/6/20	2021/6/20	101,742.0	21,812.00	101.6700	▲ 0.2300%	36.9110%	101.6800	▲ 0.2320%	2,181.0

●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	2016/6/13	2016/6/27		2,081	2,081				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2016/6/9	2016/6/10		3	3		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2016年6月10日の予定

*4月の第3次産業活動指数	*米国5月の財政収支	*エネルギー対策借入(6,000億円、6/20借入)
*5月の企業物価指数	*米国6月のミンガン大学消費者信頼感指数速報	

◆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