

# Central Daily Market Report

2016年6月10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10日		2016年6月13日		2016年6月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		900		0	
財政	▲ 9,200		▲ 3,200		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 9,200		▲ 2,300		▲ 4,000	
<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			2,100	▲ 2,500		
国債買現						
国庫短期証買入					17,500	
国債買入	9,600				12,400	
CP等買入		▲ 1,000		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援(熊本)					400	
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	400		100			
国債補充供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 400		▲ 2,700		26,300	
当座預金残高	2,856,100		2,853,400		2,879,700	
準備預金残高	2,579,100					
積み終了先	2,138,200		6月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,138,000		積数		100	
非準備預金先	277,000		1日平均		0	
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	100.00%	日数	90.32%		

## ●2016年6月10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1兆円増加の213兆9,000億円(当座預金残高見込みは285兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心に▲0.07~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後は▲0.075~▲0.025%での出合いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの出合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(6/13-6/14)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(6/14-6/15)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは、短国買入オペ等の要因があったことから、レートが若干低下した。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、10Y342がO/N中心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。本日は国庫短期証券買入オペが前回比7,500億円増額の1兆7,500億円でオファーされ、平均利回較差+0.012%、按分利回較差+0.009%と割合落ち着いた結果となった。セカンダリーでは、3M▲0.263%、1Y▲0.350%の出合いが見られた。

### <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、1,000億円強の償還に対して、900億円程度の発行となった。商社・不動産業態から大型発行が実施された。発行レートについては、概ね横ばい圏での推移となり、目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/6/10	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.084	▲ 0.155	▲ 0.025	16,601.36	▲ 67.05	107.10-11	106.84-86
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.102						
2W							-	▲ 0.117						
3W							-	▲ 0.157						
1M							-	▲ 0.172						
3M							▲ 0.266	▲ 0.188						
6M							▲ 0.379	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.310	▲ 0.222						
									日付	6/3	6/6	6/7	6/8	6/9
									日銀当預残	2,831,200	2,827,300	2,855,400	2,854,600	2,856,500
									準備預金残	2,560,500	2,556,100	2,571,500	2,567,400	2,570,500
									マネタリーベース	3,829,400	3,824,000	3,851,000	3,849,600	3,851,500
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.050%	▲0.049%	▲0.049%	▲0.050%
									コール市場残高	73,488	71,886	72,515	67,941	73,657
									うち無担	56,109	53,292	55,618	51,705	56,120
									うち有担	17,379	18,594	16,897	16,236	17,537

## ●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)
エネルギー対策	-	-	6,000	2016/6/20	2017/6/20	32,456.0	5,999.97		0.0010%	18.4866%		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
国庫短期証券買入	17,500	2016/6/14			57,072	17,501	0.009		0.012	39.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/6/14			14,401	3,501	▲0.013		▲0.010	6.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/6/14			14,355	4,404	▲0.014		▲0.013	87.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/6/14			10,751	4,504	▲0.023		▲0.020	51.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,666	2016/6/10	2016/6/13		68	68		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年6月13日の予定

\*4-6月期の法人企業景気予測調査季報

\*4月のマネタリーサーベイ

◆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