

Central Daily Market Report

2016年6月13日(月)
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13日		2016年6月14日		2016年6月15日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	800	▲ 200				0
財政	▲ 3,700	3,100				55,000
資金過不足	▲ 2,900	2,900				55,000
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			17,500			
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			400			
社債等買入				▲ 100		
ETF買入	100		300			
国債補完供給	▲ 400	100		400		
当預増減	▲ 3,700		33,500			55,000
当座預金残高	2,852,400		2,885,900			2,940,900
準備預金残高	2,584,300					
積み終了先	2,145,100		6月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,145,100		積数	100		
非準備預金先	268,100		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	93.55%		

●2016年6月13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5,000億円増加の214兆4,000億円(当座預金残高見込みは285兆3,000億円)。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▲0.08~▲0.025%での出会いで推移した。午後に入ると調整の調達が散見される中、本日の取引を終了した。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(6/14-6/15)は、▲0.095~▲0.085%程度のお合い。S/N(6/15-6/16)は、▲0.10~▲0.095%程度のお合い。S/Nは、先週末の状況と変わらず資金調達サイドのニーズが限られていることから、レートは▲0.10%程度まで下げており、お合い量も限られたものとなっていた。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S/Nは低位横ばい圏で推移。市場は材料なく閑散で、目立ったお合いは見られなかった。

<CP市場>

入札ベースでの償還総額2,300億円程度に対し、五・十日に係る発行となり、電機・石油・鉄鋼・不動産等幅広い業態から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は2,800億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの展開となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/13	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	0.050	▲ 0.050				-	▲ 0.086	▲ 0.165	▲ 0.010	16,019.18	▲ 582.18	106.49-51	106.09-10
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.029	0.050	▲ 0.003				-	▲ 0.108						
2W			0.100				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.165						
1M							-	▲ 0.175						
3M							▲ 0.264	▲ 0.188						
6M							▲ 0.379	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.222						
									日付	6/6	6/7	6/8	6/9	6/10
									日銀当預残	2,827,300	2,855,400	2,854,600	2,856,500	2,856,100
									準備預金残	2,556,100	2,571,500	2,567,400	2,570,500	2,579,100
									マネタリーベース	3,824,000	3,851,000	3,849,600	3,851,500	3,851,100
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.049%	▲0.049%	▲0.050%	▲0.049%
									コール市場残高	71,886	72,515	67,941	73,657	78,129
									うち無担	53,292	55,618	51,705	56,120	60,020
									うち有担	18,594	16,897	16,236	17,537	18,109

●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	応募総額(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)	40,000	2016/6/13	2016/6/14		423	423		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/6/13	2016/6/14		3	3		▲0.500	▲0.500	

●2016年6月14日の予定

*米国FOMC(1日目)	*米国5月の小売売上高	*国庫短期証券(614回)入札
*米国4月の企業在庫	*英国5月の消費者物価指数	(1年、25,000億円、6/20発行)

◆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