

Central Daily Market Report

2016年6月14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14日		2016年6月15日		2016年6月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 500		▲ 1,000	
財政	3,200		53,100		1,000	
資金過不足	3,000		52,600		0	
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						
国債買現						
国庫短期証買入	17,500					
国債買入	12,700					
CP等買入		▲ 600		▲ 800		
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				
E T F買入	300		400			
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当増減	33,200		52,600		0	
当座預金残高	2,885,600		2,938,200		2,938,200	
準備預金残高	2,600,400					
積み終了先	2,161,400				6月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,161,400				積数	100
非準備預金先	285,200				1日平均	100
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	96.77%	

●2016年6月14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1兆9,000億円増加の216兆3,000億円(当座預金残高見込みは288兆6,000億円)。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、ロール案件を中心に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(6/15-6/16)は、▲0.095~▲0.08%程度の出合い。S/N(6/16-6/17)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、引き続き資金調達サイドのニーズが限られたものとなっていることから、レートは▲0.10%前後の水準で、狭いレンジでの引合いに終始することとなった。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、10y317、10y336、10y338~10y342、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S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は1Y物の入札が実施され、入札結果は平均落札利回▲0.3656%・按分落札利回▲0.3587%と強めの結果となった。セカンダリー市場は▲0.45~▲0.375%での出合いが見られた。

<CP市場>

ノンバンク業態から大型の発行案件が見られたものの、全体の発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばいでの推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/14	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.085	▲ 0.170	▲ 0.005	15,859.00	▲ 160.18	106.18-20	105.85-87
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.090	0.023				-	▲ 0.110						
2W							-	▲ 0.123						
3W							-	▲ 0.167						
1M	0.000	0.200	0.033				-	▲ 0.175						
3M							▲ 0.262	▲ 0.190						
6M							▲ 0.377	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.398	▲ 0.222						
									日付	6/7	6/8	6/9	6/10	6/13
									日銀当預残	2,855,400	2,854,600	2,856,500	2,856,100	2,852,400
									準備預金残	2,571,500	2,567,400	2,570,500	2,579,100	2,584,300
									マネタリーベース	3,851,000	3,849,600	3,851,500	3,851,100	3,846,700
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.049%	▲0.050%	▲0.049%	▲0.050%
									コール市場残高	72,515	67,941	73,657	78,129	71,628
									うち無担	55,618	51,705	56,120	60,020	53,491
									うち有担	16,897	16,236	17,537	18,109	18,137

●入札結果

名称	回号	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	案分率	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	614	-	25,000	2016/6/20	2017/6/20	100,765.0	22,731.8	100.3600	▲0.3587%	86.6511%	100.3670	▲0.3656%	2,268.0

●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)	145,060	2016/6/14	2016/6/15		426	426		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/6/16	2016/6/23	0.88	0	0				

●2016年6月15日の予定

- *日銀銀政策委・金融政策決定会合(1日目、16日まで)
- *4月の石油等消費動態統計
- *米国FOMC(2日目)
- *米国FRB経済見通し発表
- *米国5月の生産者物価指数
- *米国5月の鉱工業生産・設備稼働率
- *国庫短期証券(615回)入札(3ヶ月、44,000億円、6/20発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、6/24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お客様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