# Central Daily Market Report

2016年6月15日（水）
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15日 需給速報 | | 2016年6月16日 需給予想 | | 2016年6月17日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | ▲ 600 | | ▲ 900 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 53,300 | | 1,500 | | 1,000 | |
| 資金過不足 | 52,700 | | 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 | | | | | | |
| 国債買入 | | | | | 11,500 | |
| CP等買入 | | ▲ 800 | | ▲ 200 | | |
| 貸出支援基金（成） | | | | | | |
| 貸出支援基金（貸） | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| ＥＴＦ買入 | 400 | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | 400 | | 300 | | |
| 当預増減 | 52,400 | | 700 | | 11,500 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 2,938,000 | 2,938,700 | 2,950,200 |
| 準備預金残高 | 2,648,900 | | |
| 積み終了先 | 2,194,300 | | |
| 超過準備 | 2,194,200 | | |
| 非準備預金先 | 289,100 | | |

| 6月16日以降の残り所要積立額 | |
|---|---|
| 積数 | 2,064,500 |
| 1日平均 | 68,800 |

| | |
|---|---|
| 積み期間（6/16～7/15）の所要準備額 | 2,064,500 |
| 準備預金進捗率　実績 0.00% | 日数 100.00% |

## ●2016年6月15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3兆2,000億円増加の219兆5,000億円(当座預金残高見込みは293兆8,000億円)。積みの最終日となる本日の無担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▲0.075～▲0.03%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(6/16-6/17)は、▲0.10～▲0.095%程度の出合い。S/N(6/17-6/20)は、▲0.115～▲0.095%程度の出合い。S/Nは国債買入オペがオファーされたことから資金調達ニーズが更に減退することとなり、レートは低下する展開となった。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、10y316、10y317、10y338～10y342、30y45、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物は低位横ばいで推移。短国市場は3M物の入札が実施され、入札結果は平均落札利回▲0.2636%・按分落札利回▲0.2517%と堅調な結果となった。セカンダリー市場は3Mで▲0.260～▲0.255%、1Yで▲0.423～▲0.400%の出合いが見られた。

**<CP市場>**

化学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900億円程度にとどまった。発行レートは引続き低位横ばいで推移。CP等買入オペがオファー額4,500億円で実施され、入札結果は平均・按分落札利回共に▲0.001%と落ち着いた結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/6/15 | 無担（速報） | | | 有担（速報） | | | 短国 | 東京レポレート |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計値 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.075 | 0.001 | ▲ 0.053 | | | | － | ▲ 0.087 |
| T/N | ▲ 0.010 | 0.000 | ▲ 0.006 | | | | － | ▲ 0.097 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | ▲ 0.035 | 0.060 | ▲ 0.002 | | | | － | ▲ 0.110 |
| 2W | ▲ 0.030 | 0.050 | ▲ 0.011 | | | | － | ▲ 0.161 |
| 3W | | | ▲ 0.055 | | | | － | ▲ 0.172 |
| 1M | | | | | | | － | ▲ 0.177 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.256 | ▲ 0.193 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.377 | ▲ 0.220 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.418 | ▲ 0.223 |

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替（9時） | 為替（17時） |
| ▲ 0.195 | ▲ 0.025 | 15,919.58 | 60.58 | 106.08-09 | 106.24-26 |

| 日付 | 6/8 | 6/9 | 6/10 | 6/13 | 6/14 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 2,854,600 | 2,856,500 | 2,856,100 | 2,852,400 | 2,885,600 |
| 準備預金残 | 2,567,400 | 2,570,500 | 2,579,100 | 2,584,300 | 2,600,400 |
| マネタリーベース | 3,849,600 | 3,851,500 | 3,851,100 | 3,846,700 | 3,880,000 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.049% | ▲0.050% | ▲0.049% | ▲0.050% | ▲0.050% |
| コール市場残高 | 67,941 | 73,657 | 78,129 | 71,628 | 70,084 |
| うち無担 | 51,705 | 56,120 | 60,020 | 53,491 | 52,654 |
| うち有担 | 16,236 | 17,537 | 18,109 | 18,137 | 17,430 |

## ●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 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回・利回較差 | 第Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国庫短期証券 | 615 | － | 43,500 | 2016/6/20 | 2016/9/20 | 137,305.0 | 39,584.6 | 100.0635 | **▲0.2517%** | **80.8664%** | 100.0665 | **▲0.2636%** | 3,915.0 |
| 交付税特会 | － | － | 10,500 | 2016/6/24 | 2016/12/22 | 72,369.0 | 10,500.01 | | **0.0010%** | **14.5091%** | | **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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国債買入（残存期間1年超3年以下） | 3,500 | 2016/6/17 | | | 13,525 | 3,503 | 0.001 | | 0.003 | 72.6 |
| 国債買入（残存期間3年超5年以下） | 4,400 | 2016/6/17 | | | 11,752 | 4,401 | ▲0.008 | | ▲0.007 | 52.1 |
| 国債買入（残存期間10年超25年以下） | 2,200 | 2016/6/17 | | | 6,604 | 2,207 | ▲0.020 | | ▲0.017 | 89.9 |
| 国債買入（残存期間25年超） | 1,400 | 2016/6/17 | | | 4,397 | 1,403 | ▲0.037 | | ▲0.030 | 42.7 |
| CP等買入 | 4,500 | 2016/6/20 | | | 10,792 | 4,483 | ▲0.001 | | ▲0.001 | 92.7 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 20,697 | 2016/6/15 | 2016/6/16 | | 229 | 229 | | ▲0.600 | ▲0.607 | |

## ●2016年6月16日の予定

*日銀政策委員会金金融政策決定会合
（2日目、終了後結果公表）
*黒田日銀総裁、定例会見
*米国5月の消費者物価指数
*英中銀MPC結果発表
*ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値

◆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論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