

Central Daily Market Report

2016年6月16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16日		2016年6月17日		2016年6月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 1,400			0
財政	1,600		▲ 200			56,000
資金過不足	500		▲ 1,600			56,000
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					4,200	▲ 3,400
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 600	4,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					68,700	▲ 29,800
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入			300			
国債補完供給	▲ 400	300		400		
当預増減	200		11,000		100,200	
当座預金残高	2,938,200		2,949,200		3,049,400	
準備預金残高	2,637,900					
積み終了先	964,600		6月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	664,700		積数		544,900	
非準備預金先	300,300		1日平均		18,800	
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	73.61%	日数	3.33%		

●2016年6月16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6,000億円減少の218兆9,000億円(当座預金残高見込みは293兆9,000億円)。朝方の無担O/N物は、▲0.065%のオファーに対して、▲0.070%のビッドで始まった。立ち上がりは▲0.075~▲0.035%での出会い。新しい積み期に入ったことで調達側に慎重姿勢が見られ、一巡後は▲0.085~▲0.040%のレンジでの出会いを中心に推移した。ターム物では、ロール案件の取引が散見された。本日の共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、落札額4,231億円(期落ち額3,350億円)の札割れとなった。金融政策決定会合では、政策の現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/N(6/17-6/20)は、▲0.115~▲0.09%程度のお合い。S/N(6/20-6/21)は、▲0.08~▲0.05%程度のお合い。S/Nは短国・国債の集中発行日に当たったことに加え、金融政策の現状維持が決定されたことから、資金調達ニーズが厚くなり、レートは大きく上昇する展開となった。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、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物は発行日要因から上昇。短国市場は材料なく閑散で、3M▲0.265~▲0.260%で少額のお合いが見られた程度となった。

<CP市場>

五・十日に係る発行となり、機械・石油・建設業態等から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は3,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは引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

2016/6/16	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	売値	買値	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	▲ 0.010	▲ 0.057				-	▲ 0.087	▲ 0.205	▲ 0.010	15,434.14	▲ 485.44	105.89-90	103.93-94
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.080	0.001				-	▲ 0.111						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.166						
3W							-	▲ 0.172						
1M							-	▲ 0.175						
3M							▲ 0.257	▲ 0.195						
6M							▲ 0.378	▲ 0.220						
1Y							▲ 0.416	▲ 0.223						
									日付	6/9	6/10	6/13	6/14	6/15
									日銀当預残	2,856,500	2,856,100	2,852,400	2,885,600	2,938,000
									準備預金残	2,570,500	2,579,100	2,584,300	2,600,400	2,648,900
									マネタリーベース	3,851,500	3,851,100	3,846,700	3,880,000	3,933,000
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.049%	▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%
									コール市場残高	73,657	78,129	71,628	70,084	72,915
									うち無担	56,120	60,020	53,491	52,654	55,607
									うち有担	17,537	18,109	18,137	17,430	17,308

●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)	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	2016/6/20	2016/7/4		4,231	4,231				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	15,754	2016/6/16	2016/6/17		263	263		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間1年(借り換え)	2016/6/20	2017/6/20	0	6,674
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2016/6/20	2020/6/19	0	62,028

●2016年6月17日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報	*米国5月の住宅着工件数	*流動性供給入札(4,000億円、6/21発行)
*月例経済報告(内閣府)		

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融政策方針の維持を賛成多数で決定。

◆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