

# Central Daily Market Report

2016年6月17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17日		2016年6月20日		2016年6月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 200		▲ 1,000	
財政	100		44,500		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 1,300		44,300		▲ 5,000	
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					17,500	
国債買入	12,500					
CP等買入		▲ 600	4,500	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			68,700	▲ 57,900		
被災地支援						
社債等買入				▲ 1,300		
ETF買入	300					
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当預増減	10,900		59,100		12,500	
当座預金残高	2,949,100		3,008,200		3,020,700	
準備預金残高	2,657,400					
積み終了先	2,182,400		6月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,042,100		積数		53,400	
非準備預金先	291,700		1日平均		2,100	
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	97.41%	日数	13.33%		

## ●2016年6月17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1兆6,000億円増加の220兆5,000億円(当座預金残高見込みは294兆9,000億円)。朝方の無担O/N物は、証券業態から▲0.060~▲0.035%、銀行業態から▲0.080~▲0.070%の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.035%での出合い。週末要因による取り上がり等あまり見られず、一巡後は▲0.08~▲0.040%の幅広いレンジで出合いが見られた。ターム物は、ロール案件の取引が散見される程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/20-6/21)は、▲0.07~▲0.05%程度の出合い。S/N(6/21-6/22)は、▲0.065~▲0.055%程度の出合い。S/Nは短国買入オペアがオファーされたことでレートはやや低下した。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、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。短国市場は短国買入オペアが17,500億円で実施され、平均落札較差+0.029%・按分利回較差+0.027%と、引け値の強い銘柄が入ったと考えられる無難な入札となった。出合いは3M物が▲0.255%で少額見られた程度であった。

### <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、発行総額は600億円程度にとどまった。発行レートは、月中償還物の一部では小幅上昇する展開となったが、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/6/17	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.020	▲ 0.057				-	▲ 0.075	▲ 0.155	0.050	15,599.66	165.52	104.76-78	104.24-26
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.117	0.001				-	▲ 0.091						
2W			0.000				-	▲ 0.120						
3W							-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.254	▲ 0.188						
6M							▲ 0.374	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.406	▲ 0.221						
									日付	6/10	6/13	6/14	6/15	6/16
									日銀当預残	2,856,100	2,852,400	2,885,600	2,938,000	2,938,200
									準備預金残	2,579,100	2,584,300	2,600,400	2,648,900	2,637,900
									マネタリーベース	3,851,100	3,846,700	3,880,000	3,933,000	3,934,300
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%	▲0.057%
									コール市場残高	78,129	71,628	70,084	72,915	55,689
									うち無担	60,020	53,491	52,654	55,607	40,558
									うち有担	18,109	18,137	17,430	17,308	15,131

## ●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)
流動性供給	215	-	4,000	2016/6/21	-	7,523.0	3,997.00		0.0390%	87.3015%		0.0200%	

## ●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	2016/6/21			48,617	17,500	0.027		0.029	69.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,000	2016/6/17	2016/6/20		378	378		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年6月20日の予定

\*黒田日銀総裁、慶應義塾大学にて講演 \*5月の貿易統計

◆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