

Central Daily Market Report

2016年6月20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20日		2016年6月21日		2016年6月22日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 800	▲ 200	▲ 800	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	43,600	▲ 5,100	43,600	▲ 5,100	▲ 1,000	▲ 1,000
資金過不足	43,400	▲ 5,900	43,400	▲ 5,900	▲ 2,000	▲ 2,000
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			17,600			
国債買入					5,200	
CP等買入	4,500	▲ 400		▲ 300		
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		▲ 100		
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 300	400		300		
当預増減	57,900		11,700		3,200	
当座預金残高	3,007,000		3,018,700		3,021,900	
準備預金残高	2,727,300					
積み終了先	2,228,800		6月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,223,100		積数	33,500		
非準備預金先	279,700		1日平均	1,300		
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	98.38%	日数	16.67%		

●2016年6月20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3兆4,000億円増加の223兆9,000億円(当座預金残高見込みは300兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は、証券業態から▲0.07~▲0.035%、銀行業態から▲0.08~▲0.07%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.04~▲0.035%での出会い。国債の大量償還による資金余剰で各業態とも調達意欲は弱く、一巡後は▲0.08~▲0.040%の幅広いレンジで出会いが見られた。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(6/21-6/22)は、▲0.06~▲0.045%程度のお合い。S/N(6/22-6/23)は、▲0.06~▲0.05%程度のお合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が厚く、売物しかりの展開となった。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、10y338~10y342、30y48~50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は横ばい圏で推移。市場は閑散としており、3M物が▲0.25%で少額出合った程度にとどまった。

<CP市場>

償還総額1,200億円程度に対して、発行総額は450億円強の償還超となった。発行レートに特段の動きは見られず、低位横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/20	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	▲ 0.057				-	▲ 0.064	▲ 0.150	0.005	15,965.30	365.64	104.62-65	104.53-55
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.051						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.230	0.021				-	▲ 0.087						
2W							-	▲ 0.117						
3W							-	▲ 0.125						
1M							-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.252	▲ 0.186						
6M							▲ 0.369	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.403	▲ 0.221						
									日付	6/13	6/14	6/15	6/16	6/17
									日銀当預残	2,852,400	2,885,600	2,938,000	2,938,200	2,949,100
									準備預金残	2,584,300	2,600,400	2,648,900	2,637,900	2,657,400
									マネタリーベース	3,846,700	3,880,000	3,933,000	3,934,300	3,946,600
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.050%	▲0.053%	▲0.057%	▲0.057%
									コール市場残高	71,628	70,084	72,915	55,689	67,322
									うち無担	53,491	52,654	55,607	40,558	49,031
									うち有担	18,137	17,430	17,308	15,131	18,291

●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/6/22			1,688	700	▲0.013		▲0.006	70.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/6/22			12,569	4,505	0.012		0.013	53.7
社債等買入	1,300	2016/6/24			2,314	1,300	▲0.304		▲0.217	37.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	65,218	2016/6/20	2016/6/21		141	141		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,182	2016/6/20	2016/6/21		80	80		▲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)
被災地金融支援オペ	第62回	2016/6/24	0	543

●2016年6月21日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(4月27・28日分)	*流動性供給(5,000億円、6/23発行)
----------------------------	------------------------

◆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