Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金雲給

| <u> </u> | ●貝亚而和 | | | | | | | | | | | |
|--|------------------|----------|--------|----------|-------------------|-----|--|--|--|--|--|--|
| * / * / * * * * * * * * * * * * * * * * * * | 2016年6 | 6月21日 | 2016年(| 6月22日 | 2016年6月23日 | | | | | | | |
| 単位:億円 | 需給 | 速報 | 需給 | 予想 | 当社予想 | | | | | | | |
| 銀行券 | 4 | 1,000 | 4 | 1, 100 | ▲ 2,000 | | | | | | | |
| 財政 | 4 | 6, 500 | | ▲ 800 | 4 ,000 | | | | | | | |
| 資金過不足 | 4 | 7, 500 | 4 | 1, 900 | ▲ 6,000 | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | | | | | |
| 国債買現 | | | | | | | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | 17, 600 | | | | | | | | | | | |
| 国債買入 | | | 5, 300 | | | | | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | | ▲ 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 | | ▲ 100 | | | | | | | | | | |
| ETF買入 | 100 | | 200 | | | | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | 300 | | 300 | | | | | | | | |
| 当預増減 | | 9, 800 | | 3, 700 | ▲ 6,000 | | | | | | | |
| 当座預金残高 | 3, | 016, 800 | 3, | 020, 500 | 3, 014, 500 | | | | | | | |
| 準備預金残高 | 2, | 724, 700 | | | | | | | | | | |
| 積み終了先 | 2, | 228, 100 | | 6月22日以 | J降の残り所要積立額 | | | | | | | |
| 超過準備 | 2, | 228, 000 | | 積数 | 20, 000 | | | | | | | |
| 非準備預金先 | | 292, 100 | | 1日平均 | 800 | | | | | | | |
| 積み期間(6/16~ | 7/15) <i>o</i> . |)所要準 | 備額 | | 2, 064, 500 | | | | | | | |
| 準備預金進捗率 | 実績 | | 99.03% | 日数 | 20. 00% | | | | | | | |

●2016年6月21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7,000億円増加の224兆6,000億円(当預金残高見込みは301兆9,000億円)。朝方の無担O/N物は、証券業態から▲0.04%近辺、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%近辺での出合い。一巡後は▲0.08~▲0.04%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(6/22-6/23)は、▲0.05~▲0.04%程度の出合い。S/N(6/23-6/24)は、▲0.05~▲0.04%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が厚く、売物しつ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。市場は引き続き目立った材料がなく、閑散とした中、3M物が▲0.25%で少額出合った程度であった。

<CP市場>

償還総額150億円程度に対して、発行総額は350億円強と若干の発行超。 マーケットは閑散で、発行レートは特段の動きは見られず、低位横ばい圏で の推移となった。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

| 2016/6/21 | 無担(速報) | | | | 有担 (速報) | 短国 | 果.尿 レポレート | |
|-----------|---------|---------|---------|----|---------|----|--------------|---------|
| 単位:% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計值 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.085 | ▲ 0.010 | ▲ 0.059 | | | | - | ▲ 0.055 |
| T/N | | | ▲ 0.020 | | | | _ | ▲ 0.046 |
| S/N | | | | | | | _ | _ |
| 1W | ▲ 0.050 | 0.230 | ▲ 0.029 | | | | _ | ▲ 0.083 |
| 2W | | | | | | | _ | ▲ 0.110 |
| 3W | | | | | | | | ▲ 0.113 |
| 1M | | | ▲ 0.040 | | | | _ | ▲ 0.122 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.251 | ▲ 0.180 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.367 | ▲ 0.217 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.402 | ▲ 0.220 |

| 直泊 | 丘値 | 前日 | 日比 | 15 | 15時時点 | | 前日比 | | 為替(9時) | 為替(17時) | | |
|------------|-----------|----------|-----------|--------|-----------|--------|-----------|--------|-----------|-----------|--|--|
| A 0 |).145 | 0.0 | 005 | 16 | 16,169.11 | | 203.81 | | 103.81-83 | 104.46-48 | | |
| 日付 | | 6/1 | 4 | 6/15 | | 6/16 | | 6/17 | 6/20 | | | |
| 日銀当 | 日銀当預残 | | 2,885,600 | | 2,938,000 | | 2,938,200 | | 2,949,100 | 3,007,000 | | |
| 準備預 | 準備預金残 | | 2,600,400 | | 2,648,900 | | 2,637,900 | | 2,657,400 | 2,727,300 | | |
| マネタ | マネタリーベース | | 3,880,000 | | 3,933,000 | | 3,934,300 | | 3,946,600 | 4,004,700 | | |
| 無担O | 無担O/N加重平均 | | ▲0.050% | | ▲0.053% | | ▲0.057% | | 6 ▲0.057% | ▲0.057% | | |
| コール市場残高 | | 70,084 | | 72,915 | | 55,689 | | 67,322 | 69,720 | | | |
| | ゔ゙゙゙゙゙゙ | ち無担 | 52,654 | | 55,6 | 55,607 | | 58 | 49,031 | 49,200 | | |
| | うす | うち有担 17, | | ,430 | 17,3 | 08 | 15,131 | | 18,291 | 20,520 | | |

日経平均株価

ドル/円

●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 | 東分率 | 募入 平均価格 | 募入平均利回·利 回較差 | 第 I 非価格 競争入礼(億円) |
|-------|-----|----------|-----------|-----------|-----|-------------|-------------|-----------|-----------------|----------|------------|-----------------|---------------------|
| 流動性供給 | 216 | - | 5,000 | 2016/6/23 | 1 | 16,557.0 | 4,985.00 | | ▲0.0010% | 81.3840% | | ▲0.0020% | |

●オペ結果

| 稚類 | 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) | 35,400 | 2016/6/21 | 2016/6/22 | | 217 | 217 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 10,000 | 2016/6/21 | 2016/6/22 | | 81 | 81 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 米ドル資金供給 | | 2016/6/23 | 2016/6/30 | 0.88 | 2 | 2 | | | | |

●2016年6月22日の予定

*米国5月の中古住宅販売

- ◆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。

可以に盛りるの滅びする音画で日神光音でないがのべたとい。 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