

Central Daily Market Report

2016年6月22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22日		2016年6月23日		2016年6月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 2,300		▲ 2,000	
財政	▲ 1,100		▲ 5,000			0
資金過不足	▲ 2,200		▲ 7,300		▲ 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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,300				13,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					500	▲ 500
社債等買入				▲ 100	1,300	
E T F買入	200		100			
国債補充供給		300				
当預増減	3,400		▲ 7,500		12,700	
当座預金残高	3,020,200		3,012,700		3,025,400	
準備預金残高	2,732,200					
積み終了先	2,243,400		6月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,242,300		積数		11,600	
非準備預金先	288,000		1日平均		500	
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	99.44%	日数	23.33%		

●2016年6月22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、前日比増減無しの224兆6,000億円(当預金残高見込みは302兆1,000億円)。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~▲0.065%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.04%近辺での出会い。昨日とほぼ同様の展開で、その後は▲0.075~▲0.04%まで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(6/23-6/24)は、▲0.05~▲0.04%程度のお合い。S/N(6/24-6/27)は、▲0.07~▲0.06%程度のお合い。S/Nは日銀による利国のオベが通知された影響で、レートは小幅低下しての推移。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、10y338~10y343、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は横ばい圏で推移した。明日に入札が予定されていることから全般的に様子見姿勢が強く、市場は閑散であった。

<CP市場>

償還総額1,500億円程度に対して、発行総額は3,000億円強と大幅な発行超となった。5・10日の前倒し発行にあたり、ノンバンク・建設業態において大型案件が見られた。全体の案件数もそれなりに多く、マーケットはやや活況であった。発行レートは一部の期償還物では小幅に上昇したものの、大部分は低位横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/22	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.080	▲ 0.010	▲ 0.061				-	▲ 0.050	▲ 0.149	▲ 0.004		16,065.72	▲ 103.39	104.71-73	104.38-40
T/N	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.059				-	▲ 0.049							
S/N			▲ 0.010				-	-							
1W	▲ 0.040	▲ 0.038	▲ 0.039				-	▲ 0.100							
2W	0.000	0.090	0.030				-	▲ 0.105							
3W							-	▲ 0.109							
1M							-	▲ 0.117							
3M							▲ 0.248	▲ 0.178							
6M							▲ 0.362	▲ 0.218							
1Y							▲ 0.398	▲ 0.220							
									日付	6/15	6/16	6/17	6/20	6/21	
									日銀当預残	2,938,000	2,938,200	2,949,100	3,007,000	3,016,800	
									準備預金残	2,648,900	2,637,900	2,657,400	2,727,300	2,724,700	
									マネタリーベース	3,933,000	3,934,300	3,946,600	4,004,700	4,015,400	
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.057%	▲0.057%	▲0.057%	▲0.059%	
									コール市場残高	72,915	55,689	67,322	69,720	70,168	
									うち無担	55,607	40,558	49,031	49,200	50,005	
									うち有担	17,308	15,131	18,291	20,520	20,163	

●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年超3年以下)	3,500	2016/6/24			13,491	3,505	0.002		0.003	98.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/6/24			10,557	4,405	0.001		0.002	45.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/6/24			9,586	4,503	▲0.001		0.001	91.3
国債買入(変動利付債)	1,000	2016/6/24			4,013	1,000	0.030		▲0.006	51.6
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	16,140	2016/6/22	2016/6/23			15		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月23日の予定

*木内日銀審議委員、石川県金融経済懇談会にて講演	*米国5月の新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(616回)入札(3ヶ月、44,000億円、6/27発行)
*4月の景気動向指数改訂状況		*20年利付国債入札(11,000億円、6/27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