Central Daily Market Report

2016年6月23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23日 需給速報		2016年6月24日 需給予想		2016年6月27日 当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 1,800		0	
財政	▲ 5,000		6,900		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 7,200		5,100		▲ 9,000	
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					4,100	▲ 2,100
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 1,300		
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	1,300	▲ 200		
ＥＴＦ買入	100		1,100			
国債補完供給						
当預増減	▲ 7,400		19,700		▲ 7,000	

当座預金残高	3,012,800	3,032,500	3,025,500
準備預金残高	2,716,200		
積み終了先	2,233,600		
超過準備	2,232,700		
非準備預金先	296,600		

6月24日以降の残り所要積立額	
積数	7,700
1日平均	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	99.63%	日数 26.67%

●2016年6月23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1兆円減少の223兆6,000億円(当預金残高見込みは301兆3,000億円)。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。資金調達意欲は相変わらず低調で、立ち上がりは▲0.08～▲0.07%近辺での出合い。一巡後は、一部▲0.04～▲0.03%の出合いがみられたものの、概ね▲0.08%近辺での出合いを中心に推移した。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。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4,130億円（期落ち額2,081億円）の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(6/24-6/27)は、▲0.075～▲0.065%程度の出合い。S/N（6/27-6/28）は、▲0.06～▲0.05%程度の出合い。S/N(27-28)はTDB3M物発行の影響でレート上昇しての推移。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>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。本日は新発3M物の入札が実施された。事前予想ではレートの上昇が予想されていたものの、WI取引で▲0.25%の出合いが見られたこともあり、入札結果は平均落札利回▲0.2441%・按分落札利回▲0.2224%と、按分は流れたものの、平均は引き続き堅調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.25%で少額出合った程度にとどまった。

<CP市場>

ノンバンク業態において一部まとまった発行が見られたものの、償還総額1,750億円程度に対して、発行総額は1,350億円程度にとどまり、比較的落ち着いた地合いとなった。発行レートに特段の変化は無く、低位横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/23	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.085	▲ 0.030	▲ 0.061				－	▲ 0.060
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.071
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.099
2W							－	▲ 0.102
3W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.017				－	▲ 0.106
1M			0.030				－	▲ 0.111
3M							▲ 0.242	▲ 0.173
6M							▲ 0.359	▲ 0.213
1Y							▲ 0.397	▲ 0.216

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.145	0.004	16,238.35	172.63	104.63-65	104.43-45

日付	6/16	6/17	6/20	6/21	6/22
日銀当預残	2,938,200	2,949,100	3,007,000	3,016,800	3,020,200
準備預金残	2,637,900	2,657,400	2,727,300	2,724,700	2,732,200
マネタリーベース	3,934,300	3,946,600	4,004,700	4,015,400	4,019,900
無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.057%	▲0.057%	▲0.059%	▲0.061%
コール市場残高	55,689	67,322	69,720	70,168	67,781
うち無担	40,558	49,031	49,200	50,005	47,172
うち有担	15,131	18,291	20,520	20,163	20,609

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	616	－	44,000	2016/6/27	2016/9/26	177,260.0	40,041.7	100.0555	▲0.2224%	95.1836%	100.0609	▲0.2441%	3,958.0
20年利付国債	157	0.20%	11,000	2016/6/27	2036/6/20	36,110.0	9,997.00	99.5000	0.2260%	73.4458%	99.6500	0.2180%	994.0

●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	2016/6/27	2016/7/11		4,130	4,130				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	25,203	2016/6/23	2016/6/24		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月24日の予定

*中曽日銀副総裁、全国信用金庫大会にて講演
*日銀金融政策決定会合における主な意見（6月15、16日分）
*5月の企業向けサービス価格指数
*米国5月の耐久財新規受注

◆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。
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