

Central Daily Market Report

2016年6月24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24日		2016年6月27日		2016年6月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 100			0
財政	3,000		▲ 18,300			2,000
資金過不足	1,200		▲ 18,400			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			4,100	▲ 2,100	100	▲ 6,600
国債買現						
国庫短期証買入					15,000	
国債買入	13,700				11,500	
CP等買入		▲ 1,300		▲ 800		
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	1,300	▲ 200				
E T F買入	1,100					
国債補完供給	▲ 600			600		
当預増減	15,200		▲ 16,600			22,000
当座預金残高	3,028,000		3,011,400			3,033,400
準備預金残高	2,733,900					
積み終了先	2,253,900				6月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,253,700				積数	4,900
非準備預金先	294,100				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	99.76%			日数	36.67%

●2016年6月24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1兆8,000億円増加の225兆4,000億円(当預金残高見込みは303兆3,000億円)。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。立ち上がりは▲0.04%近辺での出会いの後、▲0.08~▲0.075%近辺での出会いが見られた。一巡後は、▲0.08~▲0.07%のレンジで出会いが散見された。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。本日の共通担保資金供給オペアは、3M・15,000億円でオファーされ、落札額50億円(期落ち額6,550億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(6/27-6/28)は、▲0.065~▲0.06%程度の出合い。S/N(6/28-6/29)は、▲0.10~▲0.075%程度の出合い。S/N(28-29)は日銀による利国、短国のオペアが通知されたことや、英国の国民投票の影響で売りが出難く、寄付きは▲0.10%近辺での出会いとなった。その後は売りが見え始め、レートは▲0.075%近辺まで上昇した。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、10y338~10y343、20y155~156、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。短国買入オペアが前回比で2,500億円の減額となる1兆5,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.021%、按分落札利回較差+0.002%となるなど、一部に売りニーズは見られたものの、落ち着いた結果となった。セカンダリー市場では3M物で▲0.27~▲0.25%の出合いが見られた。英国のEU離脱が確定したものの、直接の影響は無く、様子見展開となった。

<CP市場>

石油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3,000億円弱に対して発行総額は1,000億円弱と、大幅に償還超となり、閑散なマーケットとなった。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

2016/6/24	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	▲ 0.199	▲ 0.054	14,952.02	▲ 1286.33	104.90-96	103.05-10
O/N	▲ 0.085	▲ 0.030	▲ 0.062				-	▲ 0.069						
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.101						
2W			0.000				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.265	▲ 0.173						
6M							▲ 0.344	▲ 0.214						
1Y							▲ 0.366	▲ 0.216						
日付	6/17	6/20	6/21	6/22	6/23									
日銀当預残	2,949,100	3,007,000	3,016,800	3,020,200	3,012,800									
準備預金残	2,657,400	2,727,300	2,724,700	2,732,200	2,716,200									
マネタリーベース	3,946,600	4,004,700	4,015,400	4,019,900	4,014,700									
無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.057%	▲0.059%	▲0.061%	▲0.061%									
コール市場残高	67,322	69,720	70,168	67,781	69,259									
うち無担	49,031	49,200	50,005	47,172	48,096									
うち有担	18,291	20,520	20,163	20,609	21,163									

●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	案分率	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	応募総額(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>	15,000	2016/6/28	2016/10/7		50	50				
国庫短期証券買入	15,000	2016/6/28			32,809	15,001	0.002		0.021	13.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/6/28			11,876	3,501	▲0.020		▲0.014	31.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/6/28			7,045	4,402	▲0.027		▲0.018	32.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/6/28			5,610	2,200	▲0.054		▲0.043	80.3
国債買入(残存期間25年超)	1,400	2016/6/28			4,764	1,402	▲0.088		▲0.070	20.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	22,120	2016/6/24	2016/6/27		543	543		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月27日の予定

*預金保険機構借入 (12ヶ月程度、7/8借入)

◆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