

Central Daily Market Report

2016年6月27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27日		2016年6月28日		2016年6月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 18,300		2,400		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 18,600		1,500		▲ 3,000	
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			12,500		4,800	
CP等買入		▲ 800		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入			300			
国債補充供給	▲ 500	600		500		
当預増減	▲ 17,300		22,800		1,800	
当座預金残高	3,010,700		3,033,500		3,035,300	
準備預金残高	2,721,600					
積み終了先	2,241,700					
超過準備	2,241,700					
非準備預金先	289,100					
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	99.80%	日数	40.00%		

●2016年6月27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1兆4,000億円減少の224兆円(当預金残高見込みは301兆1,000億円)。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~▲0.07%近辺の調達希望で始まった。朝方から各業態の調達意欲は低調で、立ち上がりは▲0.04%近辺で出会いの後は、▲0.08~▲0.07%の出会いとなった。一巡後も取り上がる動きは無く、▲0.08~▲0.075%のレンジを中心に推移した。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。

<レポ市場>

GC T/N(6/28-6/29)は、▲0.08~▲0.075%程度の出合い。S/N(6/29-6/30)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。資金調達サイドの慎重姿勢が強く、若干レートが低下した。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S/N物は引続き低位で推移した。英国のEU離脱が確定したことを受けて先行き不透明感が漂ったためか、3Mが若干買われ、▲0.30~▲0.27%での出会いが見られたが、全体的には様子見閑散の地合いであった。

<CP市場>

CP市場は、一部で月末の前倒し発行が見られたこともあり、償還総額1,400億円程度に対し、発行総額は2,300億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、引続き0%近辺で推移している。CP等買入オペアは、当初の予定から500億円増額の5,000億円でおアファーされた。買入対象が期末越えCPに限られることから、按分レートの低下も期待されたが、按分利回▲0.002%、平均落札利回▲0.001%と前回からほぼ変化無しの結果となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.030	▲ 0.061				-	▲ 0.072	▲ 0.200	▲ 0.001	15,309.21	357.19	102.17-23	102.01-03
T/N	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.040				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.110						
2W	0.090	0.110	0.100				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.120						
1M							-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.269	▲ 0.179						
6M							▲ 0.337	▲ 0.214						
1Y							▲ 0.357	▲ 0.216						
									日付	6/20	6/21	6/22	6/23	6/24
									日銀当預残	3,007,000	3,016,800	3,020,200	3,012,800	3,028,000
									準備預金残	2,727,300	2,724,700	2,732,200	2,716,200	2,733,900
									マネタリーベース	4,004,700	4,015,400	4,019,900	4,014,700	4,031,600
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.059%	▲0.061%	▲0.061%	▲0.062%
									コール市場残高	69,720	70,168	67,781	69,259	67,790
									うち無担	49,200	50,005	47,172	48,096	47,532
									うち有担	20,520	20,163	20,609	21,163	20,258

●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	素分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
預借借入(再生)	-	-	960	2016/7/8	2017/7/7	5,620.0	960.0		0.0000%	100.0000%		0.0000%	

●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5年超10年以下)	4,500	2016/6/29			9,247	4,503	▲0.017		▲0.011	18.0
国債買入(物価連動債)	250	2016/6/29			1,909	253	▲2.000		▲2.156	59.3
CP等買入	5,000	2016/6/30			10,565	4,990	▲0.002		▲0.001	9.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2016/6/27	2016/6/28		471	471		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/6/27	2016/6/28		34	34		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月28日の予定

*米国1-3月期のGDP確報値	*米国6月のCB消費者信頼感指数	*2年利付国債入札(23,000億円、7/15発行)
*米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数		

◆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