

Central Daily Market Report

2016年6月29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29日		2016年6月30日		2016年7月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲1,100		▲700		▲1,000	
財政	200		0		▲5,000	
資金過不足	▲900		▲700		▲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					100	▲200
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,100				11,500	
CP等買入		▲400	5,000	▲6,900		
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	100					
国債補充供給		100				
当増減	4,000		▲2,600		5,400	
当座預金残高	3,036,300		3,033,700		3,039,100	
準備預金残高	2,740,300					
積み終了先	2,267,200				6月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,267,200				積数	3,100
非準備預金先	296,000				1日平均	200
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	99.85%	日数	46.67%		

●2016年6月29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226兆4,000億円(当預金残高見込みは303兆6,000億円)。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。立ち上がりには▲0.04%近辺で出合った後は、▲0.075~▲0.07%近辺での取引が中心となった。一巡後は▲0.08~▲0.05%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中心となった。本日の共通担保資金供給オペは、3M物1兆5,000億円のオファーに対し、落ち額70億円(期落ち額220億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(6/30~7/1)は、▲0.11~▲0.105%程度の出合い。S/N(7/1~4)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N(6/30~7/1)は、期末初にあたり引き続き売り物が少なく、▲0.10%を下回る水準での出合いとなった。S/N(7/1~4)は、比較的売り物が戻り、昨日比でレートは上昇した。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、40y9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は同水準で推移した。様子見姿勢が継続しており、出会いは見られず、閑散な地合であった。

<CP市場>

CP市場は、鉄鋼、機械、石油等の複数業態でまとまった額の調達が行われ、償還総額2,300億円程に対し、発行総額5,300億円程と発行超のマーケットとなった。残高が積みあがっている一部の先ではレート上昇圧力が観測されるものの、全体としては0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/6/29	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	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲0.080	0.000	▲0.061					-	▲0.084	▲0.240	▲0.010	15,566.83	243.69	102.68-70	102.42-44
T/N	▲0.020	▲0.010	▲0.019					-	▲0.105						
S/N								-	-						
1W	0.050	0.117	0.084					-	▲0.101						
2W	▲0.040	▲0.035	▲0.037					-	▲0.104						
3W			0.000					-	▲0.110						
1M			▲0.030					-	▲0.123						
3M								▲0.274	▲0.184						
6M								▲0.288	▲0.214						
1Y								▲0.314	▲0.216						
日付		6/22	6/23	6/24	6/27	6/28									
日銀当預残		3,020,200	3,012,800	3,028,000	3,010,700	3,032,300									
準備預金残		2,732,200	2,716,200	2,733,900	2,721,600	2,739,000									
マネタリーベース		4,019,900	4,014,700	4,031,600	4,014,700	4,037,200									
無担O/N加重平均		▲0.061%	▲0.061%	▲0.062%	▲0.061%	▲0.062%									
コール市場残高		67,781	69,259	67,790	68,461	66,789									
うち無担		47,172	48,096	47,532	47,549	45,835									
うち有担		20,609	21,163	20,258	20,912	20,954									

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2016/7/1	2016/10/11		70	70				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/7/1			11,263	3,508	0.003		0.005	41.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/7/1			9,746	4,402	0.001		0.003	59.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/7/1			5,581	2,205	0.013		0.016	90.3
国債買入(残存期間25年超)	1,400	2016/7/1			5,739	1,404	0.022		0.027	88.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	431	2016/6/29	2016/6/30		12	12		▲0.600	▲0.600	

●2016年6月30日の予定

*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想：前月比▲0.1%)	*米国6月のシカゴPM景況感指数	*国庫短証券(617回)入札 (3ヶ月、44,000億円、7/4発行)
*5月の住宅着工統計	*英国1-3月期のGDP速報値	
	*ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値	

◆本資料は信頼できるとさ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自身でなされたいと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