

●資金需給

単位：億円	2016年6月30日		2016年7月1日		2016年7月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 900		1,000	
財政	▲ 1,000		▲ 2,600		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 3,500		▲ 30,000	
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	2,800	▲ 4,200
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,700			
CP等買入	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						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 3,500		9,200		▲ 31,400	
当座預金残高	3,032,800		3,042,000		3,010,600	
準備預金残高	2,725,900					
積み終了先	2,244,100		7月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,244,100		積数		2,900	
非準備預金先	306,900		1日平均		200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,064,300	
準備預金進捗率	実績	99.86%		日数	50.00%	

●2016年6月30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225兆4,000億円(当預金残高見込みは303兆4,000億円)。朝方の無担O/N物は、証券業態から▲0.05%近辺、銀行業態から▲0.08~▲0.075%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりには▲0.05%近辺で出合った後は、▲0.08~▲0.07%近辺での取引が中心となった。四半期末日にあたることから全体的に調達意欲は弱く、取引を控える先も見受けられた。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、2W物8,000億円のオファーに対し、落札額2,830億円(期落ち額4,231億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(7/1-7/4)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(7/4-7/5)は、▲0.08~▲0.075%程度の出合い。S/N(7/4-5)は、短国3Mの発行要因から売り物が多く、レート上昇となった。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S/N物は低水準で推移した。本日は3M物の入札が実施された。入札結果は、平均落札利回▲0.2957%、按分落札利回▲0.2905%と強めの結果となった。セカンダリーでは▲0.35~▲0.32%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、石油業態で一部まとまった額の発行がみられ、償還総額600億円程度に対し、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートに特段の変化は見られず、多くの銘柄が0%近辺で決着した。

●短期金融市場関連指標

2016/6/30	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	▲ 0.010	▲ 0.064				-	▲ 0.089	▲ 0.234	0.006	15,575.92	9.09	102.79-80	102.69-70	
T/N	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.092							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.098							
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.101							
3W							-	▲ 0.110							
1M							-	▲ 0.118							
3M							▲ 0.330	▲ 0.199							
6M							▲ 0.280	▲ 0.217							
1Y							▲ 0.303	▲ 0.220							
										日付	6/23	6/24	6/27	6/28	6/29
										日銀当預残	3,012,800	3,028,000	3,010,700	3,032,300	3,036,300
										準備預金残	2,716,200	2,733,900	2,721,600	2,739,000	2,740,300
										マネタリーベース	4,014,700	4,031,600	4,014,700	4,037,200	4,042,400
										無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.062%	▲0.061%	▲0.062%	▲0.061%
										コール市場残高	69,259	67,790	68,461	66,789	68,734
										うち無担	48,096	47,532	47,549	45,835	48,776
										うち有担	21,163	20,258	20,912	20,954	19,958

●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)
国庫短期証券	617	-	43,500	2016/7/4	2016/10/3	186,157.6	39,690.6	100.0725	▲0.2905%	65.8213%	100.0738	▲0.2957%	3,809.0

●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	2016/7/4	2016/7/19		2,830	2,830				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,850	2016/6/30	2016/7/1		60	60		▲0.600	▲0.600	

●2016年7月1日の予定

*5月全国・6月都都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想: 全国(5月)前年同月比(除く生鮮): ▲0.4% 東京都都区部(6月)前年同月比(除く生鮮): ▲0.5%	*米国5月の建設支出
*5月の完全失業率(市場予想: 3.2%)	*米国6月のISM製造業景況指数
*5月の有効求人倍率(市場予想: 1.35倍)	
*5月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲1.4%)	
*6月調査の日銀短観(概要及び要旨)	
市場予想: 大企業・製造業の業況判断指数(DI): +4	
*6月の消費動向調査	

◆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。