

Central Daily Market Report

2016年6月8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8日		2016年6月9日		2016年6月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲100	▲1,000			
財政	▲1,500	▲3,100	▲8,000			
資金過不足	▲900	▲3,200	▲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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入					8,400	
CP等買入		▲100	4,500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲100				
E T F買入	400					
国債補完供給	▲200	100		200		
当預増減	▲800		1,500		▲600	
当座預金残高	2,854,600		2,856,100		2,855,500	
準備預金残高	2,567,400					
積み終了先	2,126,200			6月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,126,200			積数	1,600	
非準備預金先	287,200			1日平均	200	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,141,100	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	77.42%		

●2016年6月8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1,000億円増加の213兆4,000億円(当座預金残高見込みは285兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀業態を中心にして▲0.07~▲0.03%近辺での調達で始まった。一巡後以降は▲0.075~▲0.025%での出合いが見られるなか、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/9-6/10)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/N(6/10-6/13)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、短国発行等の要因があったことから、レートは若干上昇しての出合いとなった。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30Y50Iにビッドの出入りが多く見られ、O/N中心に締まったレベルで取引となった。

<短国市場>

現先レートS/Nは下限域での推移となった。本日は、新発6Mの入札が実施された。WI取引では▲0.39~▲0.35%の水準で出合いが見られる中、入札結果は、平均落札利回▲0.3505%、按分落札利回▲0.3387%と、堅調な決着となった。セカンダリー市場は、▲0.39%の売り気配と▲0.35%の買い気配の睨み合いが続く展開となり、出合いは見られなかった。3Mは▲0.25~▲0.248%で出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは下限域での推移となった。CP発行市場は、5・10日発行にあたるため、2,100億円程度の償還に対して、2,400億円弱の発行とやや規模が膨んだ。商社・鉄鋼業態等からは大型発行案件が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/6/8	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	▲0.078	0.000	▲0.049				-	▲0.086	▲0.115	0.010	16,830.92	155.47	107.28-30	106.97-99
T/N							-	▲0.094						
S/N							-	-						
1W	▲0.025	0.000	▲0.017				-	▲0.100						
2W							-	▲0.106						
3W							-	▲0.140						
1M							-	▲0.161						
3M							▲0.254	▲0.190						
6M							▲0.377	▲0.218						
1Y							▲0.348	▲0.222						
									日付	6/1	6/2	6/3	6/6	6/7
									日銀当預残	2,866,200	2,816,900	2,831,200	2,827,300	2,855,400
									準備預金残	2,591,800	2,542,800	2,560,500	2,556,100	2,571,500
									マネタリーベース	3,865,000	3,815,500	3,829,400	3,824,000	3,851,000
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.055%	▲0.046%	▲0.050%	▲0.049%
									コール市場残高	69,426	72,656	73,488	71,886	72,515
									うち無担	52,129	56,274	56,109	53,292	55,618
									うち有担	17,297	16,382	17,379	18,594	16,897

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	612	-	35,000	2016/6/10	2016/12/12	135,211.0	31,946.9	100.1720	▲0.3387%	74.4933%	100.1780	▲0.3505%	3,053.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/6/17	2016/12/16	66,270.0	10,500.03		0.0010%	15.8444%		0.0010%	

●オペ結果

種類	オフター額(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	2016/6/10			11,521	4,506	0.001		0.003	55.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/6/10			7,132	2,203	▲0.006		▲0.003	20.8
国債買入(残存期間25年超)	1,400	2016/6/10			4,798	1,403	▲0.018		▲0.011	26.5
国債買入(物価連動債)	250	2016/6/10			1,480	254	▲0.300		▲0.393	25.8
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オフター分))	26,252	2016/6/8	2016/6/9		148	148		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ(熊本)	第1回	2016/6/14	2017/6/14	0	369

●2016年6月9日の予定

*中曾日銀副総裁、秋田県金融経済懇談会にて講演	*5月のマネーストック	*国庫短期証券(613回)入札(3ヶ月、44,000億円、6/13発行)
*4月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲3.8%)	*マクロ加算残高にかかる基準比率	*5年利付国債入札(24,000億円、6/20発行)
	*米国4月の卸売売上高	

◆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