# Central Daily Market Report

2016年6月28日（火）
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28日 需給速報 | 2016年6月29日 需給予想 | 2016年6月30日 当社予想 |
|---|---|---|---|
| 銀行券 | ▲ 1,000 | ▲ 1,200 | ▲ 700 |
| 財政 | 1,400 | 200 | 3,300 |
| 資金過不足 | 400 | ▲ 1,000 | 2,600 |

| 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 | ▲ 6,600 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | 15,000 | | | | | |
| 国債買入 | 12,500 | | 5,100 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 500 | | ▲ 400 | 5,000 | |
| 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 | | 100 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 100 | 500 | | 100 | | |
| 当預増減 | 21,600 | | 3,900 | | 7,600 | |

| | | |
|---|---|---|
| 当座預金残高 | 3,032,300 | 3,036,200 | 3,043,800 |
| 準備預金残高 | 2,739,000 | | |
| 積み終了先 | 2,263,200 | | |
| 超過準備 | 2,263,200 | | |
| 非準備預金先 | 293,300 | | |

| 6月29日以降の残り所要積立額 | |
|---|---|
| 積数 | 3,500 |
| 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 | 99.83% | 日数 | 43.33% |

## ●2016年6月28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2兆4,000億円増加の226兆4,000億円(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▲0.04%近辺、銀行業態から▲0.08～▲0.07%近辺の調達希望で始まった。昨日に続いて調達意欲は乏しく、立ち上がりに▲0.040%近辺で出合った後は、▲0.075%近辺までレートを下げて取引が行われた。一巡後は、▲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た。

**<レポ市場>**

GC T/N(6/29-6/30)は、▲0.085～▲0.08%程度の出合い。S/N(6/30-7/1)は、▲0.14～▲0.10%程度の出合い。S/N(6/30-7/1)は、四半期末越えの取引となり、資金調達サイドが薄く、▲0.14%近辺の出合いから始まったが、強い買いが一服すると▲0.10%近辺での出合いとなった。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、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。短国市場は、店頭の買いニーズから、3Mが▲0.34～▲0.30%で出合うなど、強含む展開となった。

**<CP市場>**

CP市場は月末発行に当たり、大型の発行案件が散見され、発行総額は7,700億円程度まで膨らんだ。ただ、6月末は企業が有利子負債を削減する傾向にあることから、償還が集中しており、償還総額は2兆2,000億円と、償還が発行を大きく上回った。発行レートについては、残高が積みあがっている先でやや上昇する動きが見られたものの、大半が0%近辺での決着となった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/6/28 | 無担（速報） | | | 有担（速報） | | | 短国 | 東京レポレート |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 単位：% | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 売買参考統計値 | 平均値 |
| O/N | ▲ 0.080 | ▲ 0.030 | ▲ 0.062 | | | | － | ▲ 0.079 |
| T/N | ▲ 0.045 | ▲ 0.030 | ▲ 0.042 | | | | － | ▲ 0.084 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | | | | | | | － | ▲ 0.103 |
| 2W | | | | | | | － | ▲ 0.107 |
| 3W | | | | | | | － | ▲ 0.115 |
| 1M | | | | | | | － | ▲ 0.126 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.286 | ▲ 0.175 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.305 | ▲ 0.214 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.330 | ▲ 0.216 |

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替(9時) | 為替(17時) |
| ▲ 0.230 | ▲ 0.030 | 15,323.14 | 13.93 | 101.79-81 | 102.23-25 |

| 日付 | 6/21 | 6/22 | 6/23 | 6/24 | 6/27 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 3,016,800 | 3,020,200 | 3,012,800 | 3,028,000 | 3,010,700 |
| 準備預金残 | 2,724,700 | 2,732,200 | 2,716,200 | 2,733,900 | 2,721,600 |
| マネタリーベース | 4,015,400 | 4,019,900 | 4,014,700 | 4,031,600 | 4,014,700 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.059% | ▲0.061% | ▲0.061% | ▲0.062% | ▲0.061% |
| コール市場残高 | 70,168 | 67,781 | 69,259 | 67,790 | 68,461 |
| うち無担 | 50,005 | 47,172 | 48,096 | 47,532 | 47,549 |
| うち有担 | 20,163 | 20,609 | 21,163 | 20,258 | 20,912 |

## ●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Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2年利付国債 | 366 | 0.10% | 23,000 | 2016/7/15 | 2018/7/15 | 103,621.0 | 20,903.0 | 100.7950 | ▲0.2950% | 26.4430% | 100.8030 | ▲0.2990% | 2,089.0 |

## ●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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 10,000 | 2016/6/28 | 2016/6/29 | | 77 | 77 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分） | 10,000 | 2016/6/28 | 2016/6/29 | | 2 | 2 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |
| 米ドル資金供給 | | 2016/6/30 | 2016/7/8 | 0.87 | 1,475 | 1,475 | | | | |

## ●2016年6月29日の予定

*5月の商業動態統計速報　　*米国5月の個人所得・消費支出

◆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。
◆本資料は何ら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論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