

Central Daily Market Report

2017年6月1日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2017年6月1日		2017年6月2日		2017年6月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		100		1,000	
財政	▲ 13,100		▲ 48,700		2,000	
資金過不足	▲ 13,200		▲ 48,600		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					2,000	▲ 1,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,100			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)			8,600	▲ 3,800		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入	100		300			
国債補完供給	▲ 100	600		100		
当預増減	▲ 12,800		▲ 34,500		3,200	
当座預金残高	3,504,100		3,469,600		3,472,800	
準備預金残高	3,151,800					
積み終了先	3,151,300					
超過準備	3,151,300				6月2日以降の残り所要積立額 積数 3,500 1日平均 200	
非準備預金先	352,300					
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,990,400	
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	54.84%		

※2017年5月16日から各計数にゆうちょ銀行が含まれている。

●短期金融市場関連指標

2017/6/1	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	
	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	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.074	0.050	0.010	19,860.03	209.46	110.80-82	111.00-02
T/N	▲ 0.003	0.001	0.001				-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.039	0.230	▲ 0.022				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.050	0.002	▲ 0.030				-	▲ 0.084						
3W			0.000				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.117	▲ 0.118						
6M							▲ 0.126	▲ 0.166						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.198						
									日付	5/25	5/26	5/29	5/30	5/31
									日銀当預残	3,486,000	3,506,800	3,498,500	3,515,200	3,516,900
									準備預金残	3,125,500	3,158,300	3,146,000	3,146,700	3,147,000
									マネタリーベース	4,528,300	4,549,800	4,541,000	4,557,800	4,559,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.055%	▲ 0.061%	▲ 0.061%	▲ 0.065%
									コール市場残高	92,155	94,333	90,000	93,043	91,442
									うち無担	71,305	71,865	68,033	71,401	68,648
									うちO/N	41,465	41,627	38,303	42,114	42,639
									うち有担	20,850	22,468	21,967	21,642	22,794

●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	686	-	43,600	2017/6/5	2017/9/4	196,937.0	39,514.7	100.0290	▲0.1162%	62.5021%	100.0304	▲0.1218%	4,085.0
10年利付国債	347	0.10%	23,000	2017/6/20	2027/6/20	75,828.0	20,808.0	100.4600	0.0530%	84.2394%	100.4800	0.0510%	2,170.0

●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	2017/6/5	2017/6/19		1,950	1,950				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,801	2017/6/1	2017/6/2		83	83		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月2日の予定

*5月のマネタリーベース	*5月実績/6月見込み財政資金対民間収支	*米国4月の貿易収支
*5月の消費動向調査		*米国5月の雇用統計

◆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