

Central Daily Market Report

2017年6月5日(月)

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5日		2017年6月6日		2017年6月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		1,200			0
財政	3,600		3,100			2,000
資金過不足	4,800		4,300			2,000
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			5,000			
国債買入			11,500			
CP等買入		▲900		▲800		
貸出支援基金(成)		▲100				
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	▲200	100		200		
当預増減	3,900		20,200			2,000
当座預金残高	3,472,900		3,493,100			3,495,100
準備預金残高	3,132,100					
積み終了先	3,131,900				6月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,131,900				積数	1,400
非準備預金先	340,800				1日平均	100
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	99.95%	日数	67.74%		

※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

2017/6/5	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京レポレート	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)
単位：%							売買参考値	平均値	0.045	▲0.004	20,170.82	▲6.46	110.46-47	110.52-54
O/N	▲0.086	0.001	▲0.058				-	▲0.074						
T/N	▲0.001	0.001	0.000				-	▲0.072						
S/N							-	-						
1W	▲0.045	▲0.035	▲0.043				-	▲0.079						
2W							-	▲0.081						
3W			▲0.035				-	▲0.089						
1M							-	▲0.113						
3M							▲0.118	▲0.116						
6M							▲0.123	▲0.161						
1Y							▲0.134	▲0.196						
日付		5/29	5/30	5/31	6/1	6/2								
日銀当預残	3,498,500	3,515,200	3,516,900	3,504,100	3,469,000									
準備預金残	3,146,000	3,146,700	3,147,000	3,151,800	3,123,500									
マネタリーベース	4,541,000	4,557,800	4,559,300	4,546,600	4,511,400									
無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.061%	▲0.065%	▲0.060%	▲0.059%									
コール市場残高	90,000	93,043	91,442	86,353	87,831									
うち無担	68,033	71,401	68,648	63,898	65,734									
うちO/N	38,303	42,114	42,639	38,289	40,324									
うち有担	21,967	21,642	22,794	22,455	22,097									

●入札結果

名称	回数	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,288	2017/6/5	2017/6/6		180	180		▲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	2017/6/5	2017/6/6		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月6日の予定

*4月の毎月勤労統計調査速報	*30年利付国債入札(8,000億円、6/20発行)
----------------	----------------------------

◆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。

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

●2017年6月5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12,000億円増加の313兆1,000億円(当座預金残高見込みは347兆3,000億円)。本日の無担O/N物は都銀・信託・証券業態より▲0.075~▲0.06%、地銀業態より▲0.055~▲0.04%での調達となった。積み後半となるも調達サイドは引き続き慎重な動きだった。ターム物は、ショートタームで数件の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(6/6-6/7)、S/N(6/7-6/8)共に、▲0.075~▲0.07%程度の出会いだった。特段のイベントは無く、ほぼ前日から横ばい圏のレート水準での取引だった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では5Y127、130、10Y336、343、30Y52などにビッドの出入りが見られた。

<短国市場>

現先S/Nは、低位横ばい。アウトライト市場は、レートが上昇傾向にある中、今週2回の入札を控えていることもあり、様子見閑散であった。

<CP市場>

現先レートは、引き続き低位で推移した。CP発行市場は、商社業態から大型発行案件がみられ、償還総額200億円程度に対して、発行総額600億円程度と発行超のマーケットであった。発行レートは、低位横ばい圏で推移した。