

Central Daily Market Report

2017年6月6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	2017年6月6日		2017年6月7日		2017年6月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		200			0
財政	2,800		3,500			▲ 2,000
資金過不足	4,000		3,700			▲ 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						
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		▲ 800		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
当預増減	19,400		4,000			▲ 2,000
当座預金残高	3,492,300		3,496,300			3,494,300
準備預金残高	3,147,200					
積み終了先	3,147,000				6月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,147,000				積数	1,200
非準備預金先	345,100				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	99.96%	日数	70.97%		

※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

2017/6/6	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:%							売買参考対値	平均値	0.040	▲ 0.005	19,979.90	▲ 190.92	110.39-41	109.62-64
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.071						
T/N			0.000				-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.029				-	▲ 0.078						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.048				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.116	▲ 0.114						
6M							▲ 0.123	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.194						
日付		5/30	5/31	6/1	6/2	6/5								
日銀当預残		3,515,200	3,516,900	3,504,100	3,469,000	3,472,900								
準備預金残		3,146,700	3,147,000	3,151,800	3,123,500	3,132,100								
マネタリーベース		4,557,800	4,559,300	4,546,600	4,511,400	4,514,000								
無担O/N加重平均		▲ 0.061%	▲ 0.065%	▲ 0.060%	▲ 0.059%	▲ 0.058%								
コール市場残高		93,043	91,442	86,353	87,831	95,112								
うち無担		71,401	68,648	63,898	65,734	73,159								
うちO/N		42,114	42,639	38,289	40,324	46,537								
うち有担		21,642	22,794	22,455	22,097	21,953								

●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)
30年利付国債	55	0.80%	8,000	2017/6/20	2047/6/20	26,250.0	7,228.00	99.4500	0.8220%	12.0441%	99.5800	0.8170%	765.0

●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
CP等買入	3,500	2017/6/9			12,471	3,490	▲ 0.007		0.000	2.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	48,630	2017/6/6	2017/6/7		488	488		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2017/6/8	2017/6/15	1.41	1	1				

●2017年6月7日の予定

*4月の景気動向指数速報	*米国4月の消費者信用残高	*国庫短期証券(687回)入札(6ヶ月、29,000億円、6/12発行)
*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引		*交付税特別会計借入(10,500億円、6/16借入)

◆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お客様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