

Central Daily Market Report

2017年6月7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	2017年6月7日		2017年6月8日		2017年6月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300	▲ 200	▲ 200	▲ 1,000		
財政	4,000	1,500	2,000			
資金過不足	4,300	1,300	1,000			
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						
国債買入					7,800	
CP等買入		▲ 200	▲ 300	3,500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	500	100			
当預増減	4,500	1,100	12,300			
当座預金残高	3,496,800	3,497,900	3,510,200			
準備預金残高	3,152,600					
積み終了先	3,152,500			6月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,152,500			積数	1,200	
非準備預金先	344,200			1日平均	100	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,998,100	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

※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

2017/6/7	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	0.000	19,984.62	4.72	109.49-50	109.29-31
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.072						
T/N							-	▲ 0.070						
S/N			0.001				-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.077						
2W			0.000				-	▲ 0.080						
3W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.103	▲ 0.108						
6M							▲ 0.097	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.112	▲ 0.193						
									日付	5/31	6/1	6/2	6/5	6/6
									日銀当預残	3,516,900	3,504,100	3,469,000	3,472,900	3,492,300
									準備預金残	3,147,000	3,151,800	3,123,500	3,132,100	3,147,200
									マネタリーベース	4,559,300	4,546,600	4,511,400	4,514,000	4,532,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.065%	▲ 0.060%	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.057%
									コーン市場残高	91,442	86,353	87,831	95,112	97,872
									うち無担	68,648	63,898	65,734	73,159	75,435
									うちO/N	42,639	38,289	40,324	46,537	48,685
									うち有担	22,794	22,455	22,097	21,953	22,437

●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	687	-	29,000	2017/6/12	2017/12/11	111,651.0	26,313.6	100.0490	▲ 0.0982%	48.9099%	100.0520	▲ 0.1042%	2,686.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/6/16	2017/12/14	150,224.0	10,500.06		0.0000%	7.0325%		0.0000%	

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/6/9			10,517	4,505	▲ 0.006		▲ 0.004	68.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/6/9			5,475	2,017	▲ 0.007		▲ 0.007	94.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/6/9			2,379	1,003	▲ 0.004		▲ 0.003	60.4
国債買入(物価連動債)	250	2017/6/9			1,175	250	▲ 0.280		▲ 0.321	6.7
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	27,222	2017/6/7	2017/6/8		51	51		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年6月8日の予定

*1-3月期のGDP2次速報 (市場予想：前期比年率+2.4%)	*ECB定例理事会(金融政策発表) *ユーロ圏1-3月期のGDP確報値	*国庫短期証券(688回)入札 (3ヶ月、44,000億円、6/12発行) *5年利付国債入札 (22,000億円、6/20発行)
*4月の国際収支		
*4月の特定サービス産業動態統計速報		
*5月の景気ウォッチャー調査		

◆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