

Central Daily Market Report

2017年6月9日(金)

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9日		2017年6月12日		2017年6月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		700		2,000	
財政	▲ 2,700		▲ 10,000		1,000	
資金過不足	▲ 2,700		▲ 9,300		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			2,800	▲ 2,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					7,500	
国債買入	8,500				8,800	
CP等買入	3,500	▲ 500		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	600		200			
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	9,200		▲ 9,800		19,300	
当座預金残高	3,506,500		3,496,700		3,516,000	
準備預金残高	3,147,900					
積み終了先	3,147,800				6月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,147,800				積数	
非準備預金先	358,600				1日平均	
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		99.98%		日数	
					87.10%	

※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

2017/6/9	無担(速報)			有担(速報)			短国	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.072	0.050	▲ 0.015	20,013.26	104.00	109.86-88	110.31-33
T/N	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.080						
3W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.104	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.108	▲ 0.186						
									日付	6/2	6/5	6/6	6/7	6/8
									日銀当預残	3,469,000	3,472,900	3,492,300	3,496,800	3,497,300
									準備預金残	3,123,500	3,132,100	3,147,200	3,152,600	3,154,100
									マネタリーベース	4,511,400	4,514,000	4,532,300	4,536,500	4,537,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.057%	▲ 0.056%	▲ 0.055%
									コーポ市場残高	87,831	95,112	97,872	93,230	95,014
									うち無担	65,734	73,159	75,435	70,621	73,252
									うちO/N	40,324	46,537	48,685	44,692	48,357
									うち有担	22,097	21,953	22,437	22,609	21,762

●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)
エネルギー対策	-	-	7,000	2017/6/20	2018/6/20	69,974.0	7,000.00		0.0000%	10.1364%		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
国庫短期証券買入	7,500	2017/6/13			12,124	7,501	▲ 0.019		▲ 0.007	21.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/6/13			4,911	2,801	▲ 0.008		▲ 0.003	52.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/13			6,580	3,003	▲ 0.012		▲ 0.008	79.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/6/13			4,992	2,009	▲ 0.017		▲ 0.014	5.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/6/13			2,811	1,007	▲ 0.004		▲ 0.002	78.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/6/9	2017/6/12		269	269		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年6月12日の予定

*4月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.3%)	*米国5月の財政収支
*5月の企業物価指数	

◆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