

Central Daily Market Report

2017年6月12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12日		2017年6月13日		2017年6月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	0	0	0	1,000	
財政	▲ 10,300		3,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 9,700		3,600		▲ 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	2,800	▲ 2,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			9,200			
CP等買入		▲ 800		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					900	▲ 900
社債等買入		▲ 100		▲ 400		
E T F買入	200		100			
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 10,300		19,500		▲ 1,000	
当座預金残高	3,496,200		3,515,700		3,514,700	
準備預金残高	3,143,500					
積み終了先	3,143,300					6月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,143,300					積数
非準備預金先	352,700					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	99.99%	日数	90.32%		

※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

2017/6/12	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	0.055	0.005	19,908.58	▲ 104.68	110.30-32	110.20-21
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.077						
T/N			0.001				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.111	▲ 0.106						
6M							▲ 0.111	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.185						
									日付	6/5	6/6	6/7	6/8	6/9
									日銀当預残	3,472,900	3,492,300	3,496,800	3,497,300	3,506,500
									準備預金残	3,132,100	3,147,200	3,152,600	3,154,100	3,147,900
									マネタリーベース	4,514,000	4,532,300	4,536,500	4,537,100	4,546,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.057%	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.053%
									コール市場残高	95,112	97,872	93,230	95,014	89,142
									うち無担	73,159	75,435	70,621	73,252	67,349
									うちO/N	46,537	48,685	44,692	48,357	42,714
									うち有担	21,953	22,437	22,609	21,762	21,793

●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)	30,000	2017/6/12	2017/6/13		86	86		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年6月13日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報	*米国FOMC(1日目)	*20年利付国債入札(10,000億円、6/20発行)
	*米国5月の生産者物価指数	
	*英国5月の消費者物価指数	

◆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