Central Daily Market Report

2017年6月13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13日 需給速報		2017年6月14日 需給予想		2017年6月15日 当社予想	
銀行券	▲ 100		0		▲ 1,000	
財政	3,100		▲ 1,200		48,000	
資金過不足	3,000		▲ 1,200		47,000	
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	7,500					
国債買入	9,200					
CP等買入		▲ 600		▲ 500		
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		▲ 400				
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	18,800		▲ 1,600		47,000	

当座預金残高	3,515,000	3,513,400	3,560,400
準備預金残高	3,155,400		
積み終了先	3,155,100		
超過準備	3,155,100		
非準備預金先	359,600		

6月14日以降の残り所要積立額	
積数	100
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	100.00%	日数 93.55%

※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。

●2017年6月13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1兆7,000億円増加の316兆1,000億円(当座預金残高見込みは351兆6,000億円)。本日の無担O/N物は都銀・信託・証券業態より▲0.085～▲0.065%、地銀・外銀業態より▲0.05～▲0.04%での調達となった。ターム物は、特段目立った動きは無く閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(6/14-6/15)は▲0.10～▲0.09%程度、S/N(6/15-6/16)は▲0.10～▲0.09%程度の出合い。T/N、S/Nともにほぼ同水準での推移。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5Y130～131、10Y335～346などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏での推移。アウトライト市場は、3M▲0.14～▲0.13%、6M▲0.13～▲0.1175%で若干出合いが見られた程度で薄商いの地合いに終始した。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移。CP発行市場は、五・十日発行にあたるため、小売・商社・不動産業態等からまとまった金額の発行が実施され、2,200億円程度の償還に対して、3.500億円程度の発行が見られた。発行レートは月内物を中心に若干上昇する動きも見られたが、概ね横ばい圏での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2017/6/13	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.054				－	▲ 0.083
T/N			0.005				－	▲ 0.095
S/N							－	－
1W			▲ 0.035				－	▲ 0.087
2W			▲ 0.050				－	▲ 0.087
3W							－	▲ 0.101
1M							－	▲ 0.101
3M							▲ 0.111	▲ 0.104
6M							▲ 0.111	▲ 0.137
1Y							▲ 0.112	▲ 0.184

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.060	0.005	19,898.75	▲ 9.83	109.92-94	110.23-24

日付	6/6	6/7	6/8	6/9	6/12
日銀当預残	3,492,300	3,496,800	3,497,300	3,506,500	3,496,200
準備預金残	3,147,200	3,152,600	3,154,100	3,147,900	3,143,500
マネタリーベース	4,532,300	4,536,500	4,537,100	4,546,300	4,535,400
無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.053%	▲0.054%
コール市場残高	97,872	93,230	95,014	89,142	91,288
うち無担	75,435	70,621	73,252	67,349	69,369
うちO/N	48,685	44,692	48,357	42,714	44,824
うち有担	22,437	22,609	21,762	21,793	21,919

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
20年利付国債	161	0.60%	10,000	2017/6/20	2037/6/20	35,918.0	9,030.00	100.2500	**0.5860%**	**64.9734%**	100.3000	**0.5830%**	959.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,000	2017/6/13	2017/6/14		60	60		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	8,178	2017/6/13	2017/6/14		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/6/15	2017/6/22	1.64	2	2				

●2017年6月14日の予定

*米国FOMC(2日目)
*米国FRB経済見通し発表
*米国4月の企業在庫
*米国5月の小売売上高
*米国5月の消費者物価指数
*国庫短期証券(689回)入札
（3ヶ月、44,000億円、6/19発行）
*交付税特別会計借入
（10,500億円、6/22借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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