

Central Daily Market Report

2017年6月14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14日		2017年6月15日		2017年6月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0	▲ 900	▲ 1,000			
財政	▲ 1,000	51,000	1,000			
資金過不足	▲ 1,000	50,100	0			
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					7,500	
CP等買入		▲ 500	▲ 1,000			
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						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 100	100	100			
当預増減	▲ 1,500	49,200	7,500			
当座預金残高	3,513,500	3,562,700	3,570,200			
準備預金残高	3,160,200					
積み終了先	3,160,200			6月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,160,100			積数	0	
非準備預金先	353,300			1日平均	0	
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	96.77%		

※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

2017/6/14	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.088	0.060	0.000	19,883.52	▲ 15.23	110.06-07	110.18-19
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.102	▲ 0.102						
6M							▲ 0.105	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.105	▲ 0.184						
									日付	6/7	6/8	6/9	6/12	6/13
									日銀当預残	3,496,800	3,497,300	3,506,500	3,496,200	3,515,000
									準備預金残	3,152,600	3,154,100	3,147,900	3,143,500	3,155,400
									マネタリーベース	4,536,500	4,537,100	4,546,300	4,535,400	4,554,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.053%	▲ 0.054%	▲ 0.054%
									コール市場残高	93,230	95,014	89,142	91,288	100,271
									うち無担	70,621	73,252	67,349	69,369	77,961
									うちO/N	44,692	48,357	42,714	44,824	51,771
									うち有担	22,609	21,762	21,793	21,919	22,310

●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	689	-	43,800	2017/6/19	2017/9/19	173,507.0	39,582.4	100.0250	▲0.0991%	34.4705%	100.0261	▲0.1035%	4,217.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/6/22	2017/12/21	148,512.0	10,500.02		0.0000%	7.1140%		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	2017/6/16			10,756	4,507	▲0.003		▲0.002	88.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/6/16			4,236	2,009	▲0.005		▲0.003	26.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/6/16			3,028	1,008	▲0.008		▲0.007	88.4
CP等買入	3,500	2017/6/19			11,959	3,473	▲0.005		0.002	95.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/6/14	2017/6/15		97	97		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月15日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、16日まで)	*英中銀MPC結果発表	**国庫短期証券(690回)入札(1年、23,000億円、6/20発行)
*4月の石油等消費動態統計	*米国5月の米鉱工業生産・設備稼働率	

◆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