

Central Daily Market Report

2017年6月15日(木)

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15日		2017年6月16日		2017年6月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 700			0
財政	51,100		4,600			▲ 5,000
資金過不足	50,200		3,900			▲ 5,000
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					1,800	▲ 2,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,100		6,800	
CP等買入		▲ 1,000		▲ 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				▲ 200		
ETF買入			700			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	49,100		12,400			5,100
当座預金残高	3,562,600		3,575,000			3,580,100
準備預金残高	3,211,700					
積み終了先	3,211,700				6月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,211,700				積数	2,892,200
非準備預金先	350,900				1日平均	96,400
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						2,892,200
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

※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

2017/6/15	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考対値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.085	0.050	▲ 0.010	19,831.82	▲ 51.70	109.44-45	109.51-52
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.028				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.098						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.105	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.183						
									日付	6/8	6/9	6/12	6/13	6/14
									日銀当預残	3,497,300	3,506,500	3,496,200	3,515,000	3,513,500
									準備預金残	3,154,100	3,147,900	3,143,500	3,155,400	3,160,200
									マネタリーベース	4,537,100	4,546,300	4,535,400	4,554,300	4,552,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.053%	▲ 0.054%	▲ 0.054%	▲ 0.055%
									コール市場残高	95,014	89,142	91,288	100,271	97,024
									うち無担	73,252	67,349	69,369	77,961	76,607
									うちO/N	48,357	42,714	44,824	51,771	50,977
									うち有担	21,762	21,793	21,919	22,310	20,417

●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	690	-	23,000	2017/6/20	2018/6/20	90,614.0	20,791.50	100.1130	▲ 0.1128%	55.4943%	100.1160	▲ 0.1158%	2,208.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2017/6/19	2017/7/3		1,790	1,790				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/6/19			8,089	2,806	▲ 0.002		0.000	12.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/19			9,577	3,007	▲ 0.008		▲ 0.007	31.9
国債買入(変動利付債)	1,000	2017/6/19			3,518	1,009	▲ 0.250		▲ 0.266	77.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/6/15	2017/6/16		61	61		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	18,693	2017/6/15	2017/6/16		100	100		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年6月16日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国5月の住宅着工件数	*ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値
*黒田日銀総裁、定例会見	*米国6月のミシガン大学消費者信頼感指数速報	

◆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