

Central Daily Market Report

2017年6月16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16日		2017年6月19日		2017年6月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 300			0
財政	3,500		▲ 7,600			25,000
資金過不足	2,200		▲ 7,900			25,000
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		6,900			
CP等買入		▲ 300	3,500	▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					26,400	▲ 7,000
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F買入	700		700			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	10,600		3,000			44,400
当座預金残高	3,573,200		3,576,200			3,620,600
準備預金残高	3,195,100					
積み終了先	3,158,500				6月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,250,800				積数	59,200
非準備預金先	378,100				1日平均	2,200
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	97.95%	日数	10.00%		

●2017年6月16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2兆5,000億円増加の323兆3,000億円(当座預金残高見込みは357兆5,000億円)。本日の無担O/N物は都銀・信託業態より▲0.08~▲0.075%、証券業態より▲0.075~▲0.055%、地銀業態より▲0.055~▲0.04%での調達となった。新しい積み期間に入ったものの、取り急ぎ動きは見られず、様子見姿勢でのスタートとなった。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺での出会いが見られた。昨日から本日にかけて開催された日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/N(6/19-6/20)は▲0.075~▲0.07%程度、S/N(6/20-6/21)は▲0.075~▲0.065%程度の出会い。S/Nは国債の大量発行日にあたり、業者の売物は増加している印象であった。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、10Y334~347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▲0.109~▲0.104%、1Y▲0.125~▲0.123%で出会いが見られるなど、19日に実施が見込まれる短国買入オペを睨んでの展開となった。

<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・十日発行にあたり、鉄鋼業態等からまとまった発行が見られ、総額2,700億円弱に膨らんだ。発行レートに目立った変化は無く、引き続き0%付近での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/6/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.078	0.050	0.000	19,943.26	111.44	110.98-00	111.18-19
T/N							-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.035				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.045				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.098						
3M			0.050				▲ 0.103	▲ 0.101						
6M							▲ 0.104	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.183						
									日付	6/9	6/12	6/13	6/14	6/15
									日銀当預残	3,506,500	3,496,200	3,515,000	3,513,500	3,562,600
									準備預金残	3,147,900	3,143,500	3,155,400	3,160,200	3,211,700
									マネタリーベース	4,546,300	4,535,400	4,554,300	4,552,800	4,602,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.055%	▲0.052%
									コール市場残高	89,142	91,288	100,271	97,024	95,459
									うち無担	67,349	69,369	77,961	76,607	75,482
									うちO/N	42,714	44,824	51,771	50,977	50,812
									うち有担	21,793	21,919	22,310	20,417	19,977

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	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)	29,252	2017/6/16	2017/6/19		128	128		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2017/6/20	2021/6/18	0	26,427					

●2017年6月19日の予定

*5月の貿易統計

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。 (2)資産買入れ方針(賛成7反対2)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。
--

◆本資料は信頼できるとさ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書等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