

# Central Daily Market Report

2017年6月19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19日		2017年6月20日		2017年6月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 7,100		28,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 7,400		27,700		▲ 3,000	
<b>金融調節</b>						
	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					10,000	
国債買入	6,900					
CP等買入	3,500	▲ 100		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			26,400	▲ 21,200		
被災地支援社債等買入				▲ 700		
E T F買入	700					
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	3,200		32,000		7,000	
当座預金残高	3,576,400		3,608,400		3,615,400	
準備預金残高	3,207,500					
積み終了先	3,188,900				6月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,183,900				積数	
非準備預金先	368,900				1日平均	
					1,400	
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	98.77%	日数	13.33%		

## ●2017年6月19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、前営業日比3兆円減少の320兆3,000億円(当座預金残高見込みは357兆6,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.08%、信託業態より▲0.08~▲0.065%、地銀、証券業態より▲0.06~▲0.05%での調達で始まった。一巡後は、調整程度の調達が数件見られる程度で、本日の取引を終えた。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。

### <レポ市場>

GC T/N(6/20-6/21)は▲0.07~▲0.065%程度、S/N(6/21-6/22)は▲0.075~▲0.07%程度での出会い。S/Nは短国買入オペが通知されたものの、投資家の資金調達が堅調で比較的売り物が多く見られた。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推移。アウトライト市場は、短国買入オペが市場予想通りの10,000億円で実施された。ここ最近の業者のポジションの積みあがりを反映してか、平均利回較差+0.007%、按分利回較差+0.006%と小甘い結果となった。マーケットでの出会いはオペ前に3M物が▲0.103%の出会いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散。

## ●短期金融市場関連指標

2017/6/19	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.077	0.050	0.000	20,067.75	124.49	110.97-98	111.11-12
T/N							-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.048	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.081						
2W							-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.102	▲ 0.102						
6M							▲ 0.103	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.183						
									日付	6/12	6/13	6/14	6/15	6/16
									日銀当預残	3,496,200	3,515,000	3,513,500	3,562,600	3,573,200
									準備預金残	3,143,500	3,155,400	3,160,200	3,211,700	3,195,100
									マネタリーベース	4,535,400	4,554,300	4,552,800	4,602,800	4,614,600
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.054%	▲0.055%	▲0.052%	▲0.060%
									コール市場残高	91,288	100,271	97,024	95,459	100,359
									うち無担	69,369	77,961	76,607	75,482	79,743
									うちO/N	44,824	51,771	50,977	50,812	51,523
									うち有担	21,919	22,310	20,417	19,977	20,616

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2017/6/21			32,309	10,001	0.006		0.007	55.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	58,292	2017/6/19	2017/6/20		246	246		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	30,000	2017/6/19	2017/6/20		0	0				

## ●2017年6月20日の予定

\*流動性供給入札  
(5,000億円、6/22発行)

◆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