

Central Daily Market Report

2017年6月20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20日		2017年6月21日		2017年6月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,200		▲ 2,000	
財政	28,500		▲ 2,200		▲ 3,000	
資金過不足	27,500		▲ 3,400		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 200		
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						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	31,700		6,500		▲ 5,000	
当座預金残高	3,608,100		3,614,600		3,609,600	
準備預金残高	3,216,000					
積み終了先	3,210,200		6月21日以降の残り所要積立額		積数 21,000	
超過準備	3,201,400		1日平均		800	
非準備預金先	392,100					
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	99.27%	日数	16.67%		

●2017年6月20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1兆6,000億円増加の321兆9,000億円(当座預金残高見込みは360兆8,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.08~▲0.075%、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、朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られず、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(6/21-6/22)は▲0.075~▲0.065%程度、S/N(6/22-6/23)は▲0.075~▲0.07%程度の出合い。S/Nは引き続き、投資家のまとまった資金調達ニーズが見られた。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などにビット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動意に乏しく全般的に閑散な中、3M物で▲0.102~▲0.100%の出合いが見られた程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は小売、化学業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は700億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/6/20	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.074	0.050	0.000	20,230.41	162.66	111.69-71	111.66-67
T/N							-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.080						
2W							-	▲ 0.094						
3W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.101	▲ 0.101						
6M							▲ 0.102	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.179						
									日付	6/13	6/14	6/15	6/16	6/19
									日銀当預残	3,515,000	3,513,500	3,562,600	3,573,200	3,576,400
									準備預金残	3,155,400	3,160,200	3,211,700	3,195,100	3,207,500
									マネタリーベース	4,554,300	4,552,800	4,602,800	4,614,600	4,618,000
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.055%	▲0.052%	▲0.060%	▲0.058%
									コール市場残高	100,271	97,024	95,459	100,359	93,458
									うち無担	77,961	76,607	75,482	79,743	72,037
									うちO/N	51,771	50,977	50,812	51,523	43,747
									うち有担	22,310	20,417	19,977	20,616	21,421

●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)
流動性供給	239	-	5,000	2017/6/22		13,957.0	4,989.00		0.0010%	79.5238%		▲0.0010%	

●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
社債等買入	1,500	2017/6/26			5,218	1,500	0.036		0.047	10.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24,430	2017/6/20	2017/6/21		74	74		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/6/22	2017/6/29	1.64	0	0				

●2017年6月21日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(4月26、27日開催分)
*黒田日銀総裁、全国信用金庫大会にて講演

*米国5月の中古住宅販売

◆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