

Central Daily Market Report

2017年6月21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21日		2017年6月22日		2017年6月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 1,500		▲ 2,000	
財政	▲ 2,500		▲ 8,400		1,000	
資金過不足	▲ 3,800		▲ 9,900		▲ 1,000	
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					10,300	
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	5,800		▲ 10,000		9,300	
当座預金残高	3,613,900		3,603,900		3,613,200	
準備預金残高	3,227,200					
積み終了先	3,223,200				6月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,222,300				積数	
非準備預金先	386,700				1日平均	
					700	
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	99.44%	日数	20.00%		

●2017年6月21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1兆4,000億円増加の323兆3,000億円(当座預金残高見込みは361兆5,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.07~▲0.065%、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、▲0.07~▲0.05%のレンジでの出合い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、本日も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(6/22-6/23)は▲0.07~▲0.06%程度、S/N(6/23-6/26)は▲0.07~▲0.065%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ている。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、10Y334~346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全般的に閑散であったが、引けにかけて入札を控えた調整売りか、3Mが▲0.095%でまとまった出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は25日にかかる発行となり、石油・機械・電力業態からまとまった発行が見られ総額3,000億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/6/21	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	▲ 0.056				-	▲ 0.076	0.054	0.004	20,138.79	▲ 91.62	111.33-35	111.13-14
T/N							-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.077						
2W							-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.094						
3M			0.050				▲ 0.097	▲ 0.100						
6M							▲ 0.101	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.170						
									日付	6/14	6/15	6/16	6/19	6/20
									日銀当預残	3,513,500	3,562,600	3,573,200	3,576,400	3,608,100
									準備預金残	3,160,200	3,211,700	3,195,100	3,207,500	3,216,000
									マネタリーベース	4,552,800	4,602,800	4,614,600	4,618,000	4,650,800
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.052%	▲0.060%	▲0.058%	▲0.055%
									コール市場残高	97,024	95,459	100,359	93,458	95,196
									うち無担	76,607	75,482	79,743	72,037	73,490
									うちO/N	50,977	50,812	51,523	43,747	44,630
									うち有担	20,417	19,977	20,616	21,421	21,706

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/6/23			10,792	2,801	0.007		0.008	81.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/23			11,719	3,004	0.003		0.004	33.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/6/23			17,045	4,508	▲0.001		0.000	70.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,268	2017/6/21	2017/6/22		244	244		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月22日の予定

*岩田日銀副総裁、青森県金融経済懇談会にて講演 *月例経済報告	*国庫短期証券(691回)入札 (3ヶ月、44,000億円、6/26発行)	*流動性供給入札 (5,500億円、6/26発行)
------------------------------------	--	------------------------------

◆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