

# Central Daily Market Report

2017年6月23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23日		2017年6月26日		2017年6月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 300			0
財政	4,600		▲ 9,700			2,000
資金過不足	3,000		▲ 10,000		2,000	
<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			1,300	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入						7,500
国債買入	10,400					8,800
CP等買入		▲ 700		▲ 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		▲ 200	1,500			
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	12,300		▲ 9,900		18,300	
当座預金残高	3,616,000		3,606,100		3,624,400	
準備預金残高	3,235,100					
積み終了先	3,234,100				6月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,233,800				積数	
非準備預金先	380,900				1日平均	
					500	
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	99.69%	日数	33.33%		

## ●2017年6月23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1兆5,000億円増加の324兆2,000億円(当座預金残高見込みは361兆7,000億円)。本日の無担O/N物は都銀、信託業態より▲0.065~▲0.055%、証券業態より▲0.07~▲0.05%、地銀業態より▲0.06~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は、▲0.06%近辺の出合いが散見される程度で、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.04%近辺での出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(6/26-6/27)は▲0.055~▲0.05%程度、S/N(6/27-6/28)は▲0.06~▲0.05%程度の出合い。S/Nは国債・短国買入オペアが通知されたものの、投資家からの資金調達意欲が高く、昨日のS/N対比でレートは上昇した。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、10Y334~346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短国買入オペアが7,500億円実施された。平均利回較差+0.006%、按分利回較差±0.000%とマーケットの需給を反映した軟調な結果になった。オペア後は3Mが▲0.096%で出合うなど小甘水水準で推移した。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、商社、化学業態からまとまった発行が見られ、総額1,200億円程度に達した。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

2017/6/23	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	▲ 0.051				-	▲ 0.064	0.050	0.000	20,132.67	22.16	111.29-30	111.28-29
T/N							-	▲ 0.054						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.005	▲ 0.046				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.087						
1M			0.050				-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.097	▲ 0.098						
6M							▲ 0.101	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.102	▲ 0.164						
									日付	6/16	6/19	6/20	6/21	6/22
									日銀当預残	3,573,200	3,576,400	3,608,100	3,613,900	3,603,700
									準備預金残	3,195,100	3,207,500	3,216,000	3,227,200	3,230,500
									マネタリーベース	4,614,600	4,618,000	4,650,800	4,657,800	4,649,200
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.058%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.055%
									コール市場残高	100,359	93,458	95,196	94,311	99,130
									うち無担	79,743	72,037	73,490	72,154	76,032
									うちO/N	51,523	43,747	44,630	43,104	46,092
									うち有担	20,616	21,421	21,706	22,157	23,098

## ●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	7,500	2017/6/27			18,561	7,505	0.000		0.006	56.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/6/27			9,329	2,805	0.001		0.002	25.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/27			9,967	3,004	0.002		0.003	27.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/6/27			6,225	2,002	0.005		0.007	31.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/6/27			4,491	1,000		0.009	0.010	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	42,310	2017/6/23	2017/6/26		278	278		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年6月26日の予定

*金融政策決定会合における主な意見(6月15、16日開催分)	*4月の景気動向指数改訂状況 *5月の企業向けサービス価格指数	*米国5月の耐久財新規受注
--------------------------------	------------------------------------	---------------

◆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