

Central Daily Market Report

2017年6月26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26日		2017年6月27日		2017年6月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400	▲ 800	▲ 1,000			
財政	▲ 10,700	2,400	1,000			
資金過不足	▲ 11,100	1,600	0			
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	1,300	▲ 2,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			9,000		5,500	
CP等買入		▲ 400	▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,500					
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 200	300	200			
当預増減	▲ 11,200		18,800		5,500	
当座預金残高	3,604,800		3,623,600		3,629,100	
準備預金残高	3,223,500					
積み終了先	3,222,400					
超過準備	3,222,400					
非準備預金先	381,300					
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	99.72%	日数	36.67%		

●2017年6月26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1兆7,000億円減少の322兆5,000億円(当座預金残高見込みは360兆6,000億円)。本日の無担O/N物は信託業態より▲0.07~▲0.065%、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、目立った出合いはなく、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(6/27-6/28)は▲0.050%程度、S/N(6/28-6/29)は▲0.055~▲0.050%程度の出合い。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S/N物は引き続き低位で推移した。特段の出合いも無く、閑散な地合いが続いている。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。発行市場は、小売、ノンバンク業態で比較的まとまった額の調達が行われたが、発行総額は1,000億円程度と、償還総額1,600億円弱を下回った。発行レートに特段の変化は見られず、0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/6/26	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.061	0.050	0.000	20,153.35	20.68	111.23-25	111.45-46
T/N							-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.045				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.084						
1M			0.060				-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.095	▲ 0.096						
6M							▲ 0.098	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.099	▲ 0.161						
									日付	6/19	6/20	6/21	6/22	6/23
									日銀当預残	3,576,400	3,608,100	3,613,900	3,603,700	3,616,000
									準備預金残	3,207,500	3,216,000	3,227,200	3,230,500	3,235,100
									マネタリーベース	4,618,000	4,650,800	4,657,800	4,649,200	4,663,100
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.051%
									コール市場残高	93,458	95,196	94,311	99,130	99,460
									うち無担	72,037	73,490	72,154	76,032	76,352
									うちO/N	43,747	44,630	43,104	46,092	45,772
									うち有担	21,421	21,706	22,157	23,098	23,108

●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年以下)	1,000	2017/6/28			5,055	1,002	0.051		0.059	27.0
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,500	2017/6/28			17,126	4,503	0.000		0.000	99.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/6/26	2017/6/27		183	183		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月27日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報	*4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(22,000億円、7/18発行)
	*6月の米CB消費者信頼感指数	

◆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