

Central Daily Market Report

2017年6月27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27日		2017年6月28日		2017年6月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 600		▲ 1,000	
財政	1,700		▲ 1,600		▲ 1,000	
資金過不足	800		▲ 2,200		▲ 2,000	
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	7,500					
国債買入	9,000		5,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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	700					
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	17,600		3,400		▲ 2,000	
当座預金残高	3,622,400		3,625,800		3,623,800	
準備預金残高	3,242,300					
積み終了先	3,240,800				6月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,240,800				積数 6,500	
非準備預金先	380,100				1日平均 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		99.78%		日数 40.00%	

●2017年6月27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1兆8,000億円増加の324兆3,000億円(当座預金残高見込みは362兆4,000億円)。本日の無担O/N物は都銀、信託業態より▲0.07~▲0.055%、証券業態より▲0.06~▲0.05%、地銀業態より▲0.055~▲0.045%での調達で始まった。一巡後もレート水準は変わらず、調整程度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、目立った出合いは見られず、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(6/28-6/29)は▲0.055~▲0.045%程度、S/N(6/29-6/30)は▲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。店頭見合いからか、3M▲0.103~▲0.095%で多少出合いが見られた。6Mは▲0.10%で出合いが見られた。

<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、鉄鋼、輸送用機器、電気・ガス業態等で大口の発行が行われたが、発行総額は2,200億円程度と、償還総額2,300億円を下回った。発行レートは、期間の長い物を中心に一部強含む展開も見られたが、大部分は0%近辺の狭いレンジで推移している。本日は、CP等買入オペアが、3,500億円オファーされた。今回のオペアは、対象銘柄が6月末越物に限られる為、一部では金利低下期待も見られたが、平均落札レート▲0.002%、按分落札レート▲0.004%と、前回比(平均0.002%、按分▲0.005%)で平均レートは低下、按分レートは僅かに上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/6/27	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.064	0.045	▲ 0.005	20,225.09	71.74	111.87-88	111.63-64
T/N							-	▲ 0.055						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.083						
2W			0.002				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.083						
1M							-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.095	▲ 0.094						
6M							▲ 0.098	▲ 0.128						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.157						
									日付	6/20	6/21	6/22	6/23	6/26
									日銀当預残	3,608,100	3,613,900	3,603,700	3,616,000	3,604,800
									準備預金残	3,216,000	3,227,200	3,230,500	3,235,100	3,223,500
									マネタリーベース	4,650,800	4,657,800	4,649,200	4,663,100	4,652,400
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.051%	▲0.053%
									コール市場残高	95,196	94,311	99,130	99,460	91,925
									うち無担	73,490	72,154	76,032	76,352	72,184
									うちO/N	44,630	43,104	46,092	45,772	40,674
									うち有担	21,706	22,157	23,098	23,108	19,741

●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)
2年利付国債	378	0.10%	22,000	2017/7/18	2019/7/15	120,440.0	17,749.00	100.4050	▲0.1020%	67.1989%	100.4060	▲0.1030%	4,243.0

●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
CP等買入	3,500	2017/6/30			12,117	3,475	▲0.004		▲0.002	2.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,140	2017/6/27	2017/6/28		447	447		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/6/29	2017/7/7	1.63	10	10				

●2017年6月28日の予定

*特にありません。

◆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