

# Central Daily Market Report

2017年6月28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28日		2017年6月29日		2017年6月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,200		▲ 2,300	
財政	▲ 2,200		2,200		1,300	
資金過不足	▲ 2,800		1,000		▲ 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						
国債買入	5,500				8,800	
CP等買入		▲ 300		▲ 900	3,500	
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	400		300		
当預増減	2,500		400		11,300	
当座預金残高	3,624,900		3,625,300		3,636,600	
準備預金残高	3,232,500					
積み終了先	3,231,400				6月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,231,200				積数 5,200	
非準備預金先	392,400				1日平均 300	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					2,891,700	
準備預金進捗率	実績	99.82%	日数	43.33%		

## ●2017年6月28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3,000億円増加の324兆6,000億円(当座預金残高見込みは362兆6,000億円)。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▲0.05~▲0.04%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、目立った出合いは見られず、閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/29-6/30)は▲0.05%程度、S/N(6/30-7/3)は▲0.20~▲0.10%程度を中心とした出合い。6月末をまたぐ取引となるS/Nは、オファーが出難く、前日比で大きくレート低下した。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5Y130~132、10Y330~347などにビッドの入りが目立った。

### <短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。明日の入札を控えて、全般的には様子見閑散であり、3M物が▲0.103%で少額出合った程度だった。

### <CP市場>

CP市場は月末発行に当たり、大型の発行案件が散見され、発行総額は8,200億円弱まで膨らんだ。ただ、6月末は企業が有利子負債を削減する傾向にあることから、償還が集中しており、償還総額は2兆2,700億円程と大幅償還超となった。発行レートに関しては、引き続き低位横ばい圏で推移している。0%近辺での買いニーズは強く、期間の短い物、ロットの大きい物も安定的に消化されている。

## ●短期金融市場関連指標

2017/6/28	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	▲ 0.051				-	▲ 0.065	0.054	0.009	20,130.41	▲ 94.68	112.19-21	112.14-16
T/N							-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.086						
1M			0.005				-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.093	▲ 0.095						
6M							▲ 0.097	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.159						
									日付	6/21	6/22	6/23	6/26	6/27
									日銀当預残	3,613,900	3,603,700	3,616,000	3,604,800	3,622,400
									準備預金残	3,227,200	3,230,500	3,235,100	3,223,500	3,242,300
									マネタリーベース	4,657,800	4,649,200	4,663,100	4,652,400	4,670,800
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.055%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.050%
									コール市場残高	94,311	99,130	99,460	91,925	95,429
									うち無担	72,154	76,032	76,352	72,184	75,798
									うちO/N	43,104	46,092	45,772	40,674	44,838
									うち有担	22,157	23,098	23,108	19,741	19,631

## ●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	応募総額(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	2017/6/30			7,575	2,802	▲0.009		▲0.005	49.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/30			9,877	3,003	0.003		0.005	29.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/6/30			4,222	2,006	0.010		0.012	26.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/6/30			2,049	1,003	0.015		0.018	94.7
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	30,922	2017/6/28	2017/6/29		218	218		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年6月29日の予定

*原田日銀審議委員、 資本市場研究会にて講演 *5月の商業動態統計速報	*米国1-3月期のGDP確報値	*国庫短期証券(692回)入札 (3ヶ月、44,000億円、7/3発行)
---	-----------------	---

◆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