

●資金需給

単位：億円	2017年6月29日		2017年6月30日		2017年7月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 700		1,000	
財政	2,100		▲ 400		▲ 2,000	
資金過不足	900		▲ 1,100		▲ 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					1,600	▲ 1,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,100			
CP等買入		▲ 900	3,500	▲ 5,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入			500			
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当増増減	200		7,000		▲ 1,200	
当座預金残高	3,625,100		3,632,100		3,630,900	
準備預金残高	3,236,900					
積み終了先	3,236,000					
超過準備	3,236,000					
非準備預金先	388,200					
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	99.85%	日数	46.67%		

●2017年6月29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1兆円減少の323兆6,000億円(当座預金残高見込みは362兆5,000億円)。本日の無担O/N物は都銀業態より▲0.07%、信託・証券業態より▲0.07~▲0.055%、地銀業態より▲0.055~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は、ビッドが薄くなり、▲0.06%近辺の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、7月スタートのショートターム物で▲0.04%近辺の出合いが見られた。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオファーされ、応募額1,590億円(期落ち分1,790億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(6/30~7/3)は▲0.30~▲0.20%程度、S/N(7/3~7/4)は▲0.055~▲0.050%程度を中心とした出合い。S/Nは6月末要因が剥落し、前日比でレート上昇となった。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。本日は3M物の入札が実施された。▲0.09%近くに向けてレートが上昇することも予想されたものの、WI取引で▲0.10%の出合いが見られたこともあり、平均落札利回▲0.0982%、按分落札利回▲0.0942%と、予想より若干しつかりとした結果になった。出合いは3M物で▲0.10~▲0.093%、6M物で▲0.1025~▲0.10%、1Y物で▲0.10%の水準でみられた。

<CP市場>

CP市場は、発行日が四半期明けとなることもあり、四半期末で残高を調整していた発行体等による発行も盛り上がり、償還総額ゼロに対し、発行総額5,200億円弱と活況なマーケットとなった。特に、ノンバンク、機械、鉄鋼、卸売、食料品業態では500億円超での大口での発行が散見された。発行レートは、一部銘柄を除き、引き続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/6/29	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.068	0.055	0.001	20,220.30	89.89	112.34-35	112.50-51
T/N	▲ 0.080	▲ 0.070	▲ 0.075				-	▲ 0.305						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.041				-	▲ 0.076						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.078						
1M	▲ 0.050	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.083						
3M			0.050				▲ 0.096	▲ 0.098						
6M							▲ 0.096	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.158						
									日付	6/22	6/23	6/26	6/27	6/28
									日銀当預残	3,603,700	3,616,000	3,604,800	3,622,400	3,624,900
									準備預金残	3,230,500	3,235,100	3,223,500	3,242,300	3,232,500
									マネタリーベース	4,649,200	4,663,100	4,652,400	4,670,800	4,673,800
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.051%
									コール市場残高	99,130	99,460	91,925	95,429	91,188
									うち無担	76,032	76,352	72,184	75,798	71,153
									うちO/N	46,092	45,772	40,674	44,838	40,703
									うち有担	23,098	23,108	19,741	19,631	20,035

●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)
国庫短期証券	692	-	43,600	2017/7/3	2017/10/2	146,979.0	35,685.50	100.0235	▲0.0942%	70.7230%	100.0245	▲0.0982%	7,914.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/7/3	2017/7/18		1,590	1,590				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,720	2017/6/29	2017/6/30		114	114		▲0.600	▲0.600	

●2017年6月30日の予定

- *5月の完全失業率(市場予想：2.8%)
- *5月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲0.6%)
- *5月の有効求人倍率(市場予想：1.48倍)
- *5月全国・6月都区部消費者物価指数(CPI)
- 市場予想：全 国(5月)前年同月比(除く生鮮)：+0.4%
- 市場予想：東京都区部(6月)前年同月比(除く生鮮)：+0.2%
- *5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲3.2%)
- *5月の住宅着工統計
- *米国5月の個人所得・消費支出
- *米国6月のシカゴPM景況感指数
- *英国1-3月期のGDP確報値
- *ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値

◆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