

# Central Daily Market Report

2017年6月22日(木)

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22日		2017年6月23日		2017年6月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 1,500		▲ 1,000	
財政	▲ 8,500		5,100		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 10,000		3,600		▲ 9,000	
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					1,300	▲ 2,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,400			
CP等買入		▲ 400		▲ 700		
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	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 10,200		13,200		▲ 8,800	
当座預金残高	3,603,700		3,616,900		3,608,100	
準備預金残高	3,230,500					
積み終了先	3,228,200					
超過準備	3,227,100					
非準備預金先	373,200					
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	99.56%	日数	23.33%		

## ●2017年6月22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6,000億円減少の322兆7,000億円(当座預金残高見込みは360兆4,000億円)。本日の無担O/N物は都銀、信託業態より▲0.07~▲0.065%、証券業態より▲0.07~▲0.055%、地銀業態より▲0.06~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は、▲0.07%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、目立った出合いは見られなかった。固定金利方式の共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオファーされ、応札額1,310億円(期落ち分2,580億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/23-6/26)は▲0.065~▲0.06%程度、S/N(6/26-6/27)は▲0.065~▲0.06%程度の出合い。S/Nは短期3Mの発行要因もあり、昨日のS/Nと比べて0.5bp程度レートが上昇した。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3ヵ月物の入札が実施された。WI取引において▲0.099~▲0.095%の出合いが見られ、平均落札利回▲0.1002%、按分落札利回▲0.0962%と概ね事前予想通りの結果になった。セカンダリーは▲0.098~▲0.097%の出合いと小動きに終わった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は鉄鋼、石油、ノンバンク業態からまとまった発行が見られ、総額1,600億円程度に達した。発行レートは概ね0%近辺での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/6/22	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.070	0.050	▲ 0.004	20,110.51	▲ 28.28	111.32-34	111.00-02
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.020	▲ 0.031				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.007				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.092						
3M			0.050				▲ 0.098	▲ 0.100						
6M							▲ 0.101	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.168						

## ●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	691	-	44,100	2017/6/26	2017/9/25	164,232.0	39,877.3	100.0240	▲0.0962%	45.9318%	100.0250	▲0.1002%	4,222.0
流動性供給	240	-	5,500	2017/6/26		15,755.0	5,479.00		▲0.0030%	90.6271%		▲0.0040%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/6/26	2017/7/10		1,310	1310				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,424	2017/6/22	2017/6/23		116	116		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年6月23日の予定

\*米国5月の新築一戸建て販売件数

◆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