

◀資金需給▶

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想		1日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300		▲ 800		1,000
財政		▲ 14,500		2,900		▲ 14,000
資金過不足		▲ 15,800		2,100		▲ 13,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				7,200		2,100
72,268				▲ 4,700		▲ 2,200
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入				8,200		
CP等買入				2,500		
		▲ 300		▲ 2,800		
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470						
被災地支援						
3,244						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入		300				
国債補完供給						
小計		▲ 100		10,400		▲ 100
当預増減		▲ 15,900		12,500		▲ 13,100

当座預金残高	2,119,800	5/28以降の残り所要積立額	21,800
準備預金残高	1,927,500	5/29以降の残り所要積立額	19,000
積み終了先	1,615,200	積数	1,100
超過準備	1,614,900	1日平均	1,100
非準備先残高	192,300		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,011,500		
準備預金進捗率	99.06% (実績)	41.94% (日数)	

5/27のマネタリーベース		3,077,400	
5/27コール	合計	196,469	無担 66,881 有担 129,588
コール前日増減	計	3,738	無担 2,175 有担 1,563

5/28の加重平均レート(速報)			5/27の加重平均レート(確報)			単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.055 ~0.125 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.130 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.122 (0.071)					0.067 ~0.130 (0.091)	
					0.122 (0.122)	
0.117 ~0.130 (0.120)					0.067 ~0.122 (0.089)	
0.118 (0.118)					0.116 ~0.310 (0.162)	
0.118 (0.118)						
		0.08-0.13	-		0.260 (0.260)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.001-0.005			
		-	-			
		-	▲0.029~▲0.02			

◀オペ情報、入札結果▶

全店共通 8,000億円 6/1 ~ 8/31 (91日間) 応札 2,070億円 落札 2,070億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 1,431億円 5/28 ~ 5/29 (1日間) 応札 5億円 落札 5億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill3M 応札13兆2,708億円 落札4兆9,621億6,000万円(非競争入札:4,478億円) 6/1~8/31 0.0040% 按分68.9119% 平均0.0012%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札8兆8,073億円 落札2兆3,003億円(I非競争入札:1,982億円) 6/15~2017/6/15 0.002% 按分56.9884% 平均0.001%

◀ 5/29の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,132,300	前日比	12,500
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.07~0.075%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

◀ 28日のインターバンク市場動向 ▶
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆9,000億円減の161兆6,000億円(当座預金残高見込みは212兆円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07~0.072%での調達で始まった。20年債の発行日にあたり、一定の調達ニーズが示された。一巡後のビッド水準はやや低下し、0.065~0.07%で散発的に出合うなか本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から2W物0.118%でまとまった調達が見られた。

◀ 28日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は、新発3M物の入札が実施された。平均落札利回り0.0012%、按分落札利回り0.004%、按分率68.9119%と概ね事前予想通りの結果となった。アウトライトは、3M:0.001~0.005%、1Y:▲0.029~▲0.02%での出合いが見られた。CP市場は、発行が月初にあたったものの、発行総額が膨らみ5,000億円強となった。発行レートは全体的には横ばいながらも、一部の銘柄では若干のレート上昇が見られた。

◀ 29日の材料 ▶
 *4月の完全失業率(市場予想: 3.4%)
 *4月の有効求人倍率(市場予想: 1.15倍)
 *4月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比+3.1%)
 *4月全国・5月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全 国(4月)前年同月比(除く生鮮): +0.2%
 東京都区部(5月)前年同月比(除く生鮮): +0.1%
 *4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比+0.8%)
 *4月の住宅着工統計
 *米国1-3月期のGDP改定値 *米国5月のシカゴPM景況感指数

JGB新発10年債	0.395	0.005	日経平均株価(終値)	20,551.46	78.88	為替(9時)	123.73-75
						為替(5時)	123.63-64

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	5/21	5/22	5/25	5/26	5/27	5/28
日銀当預残	2,086,100	2,098,900	2,083,600	2,102,800	2,135,700	2,119,800
準備預金残	1,890,900	1,903,600	1,894,700	1,913,100	1,942,400	1,927,500
レート	0.070%	0.072%	0.069%	0.071%	0.074%	0.071%
月中平均	0.06824%	0.06871%	0.06872%	0.06881%	0.06900%	0.06907%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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論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