

# Central Daily Market Report

2017年5月9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5月9日		2017年5月10日		2017年5月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,900		3,400		3,000	
財政	3,800		▲ 600		▲ 20,000	
資金過不足	7,700		2,800		▲ 17,000	
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	5,000					
国債買入			3,900			
CP等買入		▲ 600		▲ 600		
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	▲ 1,500	2,500		1,500		
当預増減	13,100		7,600		▲ 17,000	
当座預金残高	3,530,700		3,538,300		3,521,300	
準備預金残高	3,163,500					
積み終了先	2,661,100				5月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,661,100				積数	900
非準備預金先	367,200				1日平均	200
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						2,240,700
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	80.00%		

## ●2017年5月9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267兆4,000億円(当座預金残高見込みは353兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・証券を中心に▲0.07~▲0.06%の調達希望で始まった。積み最終日を来週に控え、全般的に調達意欲が強く取り上がり▲0.055~▲0.05%の出会い。一巡後は▲0.05%の取り残りの展開であった。ターム物は引き続き閑散であった。

### <レポ市場>

GC取引はT/N(5/10-5/11)が▲0.200~▲0.090%程度、S/N(5/11-5/12)が▲0.150~▲0.100%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達ニーズが弱く、オファーが出難い状況であった。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5y126、127、130、131、10y336、343、346、20y160等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。閑散な地合が続く中、3Mが▲0.1425%、6Mが▲0.145%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、卸売、石油業態等で比較的まとまった額の調達が行われたが、発行総額は1,000億円程度と、償還総額1,200億円弱を下回った。発行レートは引続き、横ばい圏で推移している。本日は、CP等買入オペが、2,500億円でオファーされた。4月中の3,500億円より少額での実施ということもあり、結果は平均落札レート▲0.002%、按分落札レート▲0.005%と、前回比(平均▲0.012%、按分▲0.019%)で共に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/5/9	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.090	0.030	0.005	19,843.00	▲ 52.70	113.21-23	113.63-64
T/N							-	▲ 0.122						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.103						
2W							-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.107						
1M			0.005				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.139	▲ 0.130						
6M							▲ 0.140	▲ 0.180						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.209						
									日付	4/27	4/28	5/1	5/2	5/8
									日銀当預残	3,554,200	3,565,100	3,553,700	3,549,700	3,517,600
									準備預金残	3,170,400	3,182,500	3,186,200	3,175,000	3,175,500
									マネタリーベース	4,607,300	4,621,800	4,612,800	4,609,900	4,573,100
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.074%	▲0.074%	▲0.070%	▲0.065%
									コール市場残高	82,404	81,143	88,161	88,998	89,304
									うち無担	63,605	61,184	68,187	66,124	66,620
									うちO/N	33,320	34,084	40,633	38,121	40,660
									うち有担	18,799	19,959	19,974	22,874	22,684

## ●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)
10年利付国債	346	0.10%	23,000	2017/5/11	2027/3/20	78,124.0	20,772.0	100.6700	0.0310%	47.6053%	100.6800	0.0300%	2,215.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/5/17	2017/11/16	150,848.0	10,500.11		0.0000%	7.0033%		0.0000%	

## ●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	2,500	2017/5/12			9,110	2,495	▲0.005		▲0.002	98.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,801	2017/5/9	2017/5/10		1,480	1,480		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/5/11	2017/5/18	1.41						

## ●2017年5月10日の予定

*決定会合における主な意見(4月26、27日分)	*米国4月の財政収支	*国庫短期証券(681回)入札(6ヶ月、29,000億円、5/12発行)
*3月の景気動向指数速報		
*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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