

# Central Daily Market Report

2017年5月10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5月10日		2017年5月11日		2017年5月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,500		1,600		1,000	
財政	100		▲ 26,300		▲ 20,000	
資金過不足	3,600		▲ 24,700		▲ 19,000	
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	3,900				10,300	
CP等買入		▲ 600		▲ 500	2,500	
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	▲ 800	1,500		800		
当預増減	7,600		▲ 24,400		▲ 6,200	
当座預金残高	3,538,300		3,513,900		3,507,700	
準備預金残高	3,164,700					
積み終了先	2,661,600				5月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,661,600				積数	800
非準備預金先	373,600				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	83.33%		

## ●2017年5月10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1兆6,000億円減少の265兆8,000億円(当座預金残高見込みは353兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・証券を中心に▲0.06~▲0.05%の調達希望で始まった。本日も積み最終日に向けた調整の動きから取り上がりの展開となり、立ち上がりは▲0.04%近辺の出合い。一部では▲0.035%まで取り上がる動きも散見された。一巡後は閑散とした中、本日の取引を終えた。ターム物は引き続き目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC取引はT/N(5/11-5/12)が▲0.100~▲0.090%程度、S/N(5/12-5/15)が▲0.100~▲0.095%程度の出合い。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、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。本日は6M物の入札が実施された。WI取引において、▲0.145~▲0.14%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1382%、按分落札利回▲0.1302%と概ね事前予想通りながらも、WI取引より甘い結果となった。セカンダリーでは3M▲0.144~▲0.14%、6M▲0.145~▲0.137%の水準で出合いがみられた。

### <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、ノンバンク業態でまとまったロットの発行がみられ、償還総額300億円弱に対し、発行総額は800億円弱と発行超となった。発行レートは一部銘柄を除き、0%近辺の狭いレンジで推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2017/5/10	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.107	0.035	0.005	19,900.09	57.09	113.70-71	113.90-91
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.108						
1M	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.139	▲ 0.129						
6M							▲ 0.137	▲ 0.180						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.209						
									日付	4/28	5/1	5/2	5/8	5/9
									日銀当預残	3,565,100	3,553,700	3,549,700	3,517,600	3,530,700
									準備預金残	3,182,500	3,186,200	3,175,000	3,175,500	3,163,500
									マネタリーベース	4,621,800	4,612,800	4,609,900	4,573,100	4,582,200
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.074%	▲0.070%	▲0.065%	▲0.053%
									コール市場残高	81,143	88,161	88,998	89,304	88,546
									うち無担	61,184	68,187	66,124	66,620	67,651
									うちO/N	34,084	40,633	38,121	40,660	41,919
									うち有担	19,959	19,974	22,874	22,684	20,895

## ●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	681	-	29,000	2017/5/12	2017/11/10	109,580.5	26,310.70	100.0650	▲0.1302%	51.0331%	100.0690	▲0.1362%	2,689.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/5/12			8,563	2,807	0.005		0.005	80.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/5/12			10,410	3,004	0.006		0.007	22.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/12			12,857	4,514	0.002		0.003	10.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,742	2017/5/10	2017/5/11		821	821		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年5月11日の予定

*3月の国際収支	*米国4月の生産者物価指数	*国庫短期証券(682回)入札(3ヶ月、44,000億円、5/15発行)
*4月の景気ウォッチャー調査	*英中銀MPC結果発表	*30年利付国債入札(8,000億円、5/15発行)
		*エネルギー対策特別会計借入(7,000億円、5/22借入)

◆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。

◆本資料は何ら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