

# Central Daily Market Report

2017年5月16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16日		2017年5月17日		2017年5月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,400		600			0
財政	2,300		8,100			▲ 22,000
資金過不足	3,700		8,700			▲ 22,000
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	10,000					
国債買入	7,500					
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
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	▲ 600	800		600		
当預増減	21,300		9,200			▲ 22,000
当座預金残高	3,497,200		3,506,400			3,484,400
準備預金残高	3,119,300					
積み終了先	986,300				5月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	750,300				積数	620,600
非準備預金先	377,900				1日平均	20,700
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						2,989,500
準備預金進捗率	実績	79.24%	日数			3.23%

※2017年5月16日から各係数にゆうちょ銀行が含まれている。

## ●短期金融市場関連指標

2017/5/16	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	売買差	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.075	0.010	▲ 0.048				-	▲ 0.092	0.040	0.005	19,919.82	49.97	113.64-65	113.45-46
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.035	▲ 0.008	▲ 0.028				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.104						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.130	▲ 0.129						
6M							▲ 0.131	▲ 0.178						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.207						
									日付	5/9	5/10	5/11	5/12	5/15
									日銀当預残	3,530,700	3,538,300	3,513,700	3,506,800	3,475,900
									準備預金残	3,163,500	3,164,700	3,157,800	3,150,200	3,141,600
									マネタリーベース	4,582,200	4,586,400	4,560,100	4,551,700	4,518,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.042%	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.033%
									コール市場残高	88,546	91,572	91,935	96,845	92,190
									うち無担	67,651	73,294	71,425	75,555	69,389
									うちO/N	41,919	48,359	45,789	49,497	45,568
									うち有担	20,895	18,278	20,510	21,290	22,801

## ●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)
5年利付国債	131	0.10%	22,000	2017/5/18	2022/3/20	71,413.0	19,873.0	101.0400	▲ 0.1130%	41.5877%	101.0600	▲ 0.1170%	2,118.0
国有林野借入	-	-	590	2017/5/25	2022/5/25	2,081.0	590.00		0.0010%	100.0000%		0.0010%	

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	42,740	2017/5/16	2017/5/17		583	583		▲ 0.500	▲ 0.500	
米ドル資金供給		2017/5/18	2017/5/25	1.41	1	1				

## ●2017年5月17日の予定

*3月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+2.1%)	*国庫短期証券(683回)入札(1年、23,000億円、5/22発行)
*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値	

◆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