

# Central Daily Market Report

2017年5月17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17日		2017年5月18日		2017年5月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	0	0	0	0	0
財政	7,400	▲ 22,200	▲ 22,200	▲ 22,200	3,000	3,000
資金過不足	8,000	▲ 22,200	▲ 22,200	▲ 22,200	3,000	3,000
<b>金融調節</b>	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					10,300	
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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	▲ 700	600		700		
当預増減	7,800		▲ 21,700		13,300	
当座預金残高	3,505,000		3,483,300		3,496,600	
準備預金残高	3,143,200					
積み終了先	3,020,300					
超過準備	2,677,900					
非準備預金先	361,800					
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	94.81%	日数	6.45%		

※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

2017/5/17	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.093	0.039	▲ 0.001	19,814.88	▲ 104.94	112.69-70	112.44-45
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.030	▲ 0.059				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.040	▲ 0.034	▲ 0.038				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.125	▲ 0.128						
6M							▲ 0.127	▲ 0.178						
1Y							▲ 0.153	▲ 0.207						
									日付	5/10	5/11	5/12	5/15	5/16
									日銀当預残	3,538,300	3,513,700	3,506,800	3,475,900	3,497,200
									準備預金残	3,164,700	3,157,800	3,150,200	3,141,600	3,119,300
									マネタリーベース	4,586,400	4,560,100	4,551,700	4,518,800	4,538,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.033%	▲ 0.048%
									コール市場残高	91,572	91,935	96,845	92,190	92,268
									うち無担	73,294	71,425	75,555	69,389	72,477
									うちO/N	48,359	45,789	49,497	45,568	47,029
									うち有担	18,278	20,510	21,290	22,801	19,791

## ●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	683	-	23,000	2017/5/22	2018/5/21	97,014.5	20,941.80	100.1460	▲ 0.1461%	89.8648%	100.1560	▲ 0.1561%	2,058.0

## ●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	2017/5/19			11,013	2,804	0.007		0.007	76.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/5/19			8,789	3,004	0.003		0.004	78.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/19			12,335	4,510	0.002		0.003	53.6
CP等買入	2,500	2017/5/22			9,398	2,495	▲ 0.010		0.005	10.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,801	2017/5/17	2017/5/18		700	700		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/5/17	2017/5/18		15	15		▲ 0.500	▲ 0.500	

## ●2017年5月18日の予定

*1-3月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率+1.7%)	*国庫短期証券(684回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/22発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、5/26借入)
*3月の石油等消費動態統計	*20年利付国債入札 (10,000億円、5/22発行)	

◆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