

Central Daily Market Report

2017年5月18日(木)

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18日		2017年5月19日		2017年5月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		200		0	
財政	▲ 22,900		▲ 200		▲ 21,000	
資金過不足	▲ 22,800		0		▲ 21,000	
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					1,800	▲ 1,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 100	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				▲ 100		
ETF買入						
国債補充供給	▲ 200	700		200		
当預増減	▲ 22,500		10,500		▲ 18,400	
当座預金残高	3,482,500		3,493,000		3,474,600	
準備預金残高	3,135,900					
積み終了先	3,083,400					
超過準備	3,051,100					
非準備預金先	346,600					
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	97.65%	日数	9.68%		

※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

2017/5/18	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.093	0.040	0.001	19,553.86	▲ 261.02	111.06-07	110.91-92
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.101						
3W			▲ 0.050				-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.128	▲ 0.127						
6M							▲ 0.127	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.205						

●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	684	-	43,800	2017/5/22	2017/8/21	175,614.0	39,623.0	100.0310	▲ 0.1243%	32.1837%	100.0321	▲ 0.1287%	4,176.0
20年利付国債	160	0.70%	10,000	2017/5/22	2037/3/20	34,537.0	9,000.0	102.4000	0.5650%	35.5348%	102.4900	0.5600%	990.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/5/26	2017/11/24	147,716.0	10,500.12		0.0000%	7.1527%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2017/5/22	2017/6/5		1,840	1840				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,976	2017/5/18	2017/5/19		192	192		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年5月19日の予定

*特にありません。

◆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