

# Central Daily Market Report

2017年5月19日(金)

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19日		2017年5月22日		2017年5月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		600			0
財政	▲ 600		▲ 24,900			3,000
資金過不足	▲ 400		▲ 24,300			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			1,800	▲ 1,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	10,500				3,700	
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	9,800		▲ 22,500			16,700
当座預金残高	3,492,300		3,469,800			3,486,500
準備預金残高	3,131,700					
積み終了先	3,127,300				5月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,115,900				積数	23,000
非準備預金先	360,600				1日平均	900
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	99.23%	日数	19.35%		

※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

2017/5/19	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.092	0.035	▲ 0.005	19,590.76	36.90	111.42-44	111.47-48
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.070						
S/N	▲ 0.035	0.001	▲ 0.022				-	-						
1W	▲ 0.037	▲ 0.020	▲ 0.032				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.102						
1M			0.005				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.130	▲ 0.126						
6M							▲ 0.129	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.205						
									日付	5/12	5/15	5/16	5/17	5/18
									日銀当預残	3,506,800	3,475,900	3,497,200	3,505,000	3,482,500
									準備預金残	3,150,200	3,141,600	3,119,300	3,143,200	3,135,900
									マネタリーベース	4,551,700	4,518,800	4,538,800	4,546,000	4,523,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.037%	▲ 0.033%	▲ 0.048%	▲ 0.051%	▲ 0.052%
									コール市場残高	96,845	92,190	92,268	91,467	91,507
									うち無担	75,555	69,389	72,477	71,145	70,259
									うちO/N	49,497	45,568	47,029	46,415	45,148
									うち有担	21,290	22,801	19,791	20,322	21,248

## ●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2017/5/23			30,923	10,004	0.000		0.002	61.0
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/5/23			5,772	702	0.042		0.045	40.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/5/23			6,069	2,011	0.001		0.002	31.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/5/23			4,115	1,005	▲ 0.007		▲ 0.006	92.5
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	21,824	2017/5/19	2017/5/22		290	290		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2017年5月22日の予定

\*4月の貿易統計

◆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