

# Central Daily Market Report

2017年5月22日(月)

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22日		2017年5月23日		2017年5月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 200		▲ 1,000	
財政	▲ 23,900		1,100		2,000	
資金過不足	▲ 23,300		900		1,000	
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			10,000			
国債買入			4,100		6,100	
CP等買入	2,500	▲ 1,100		▲ 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	▲ 500	300		500		
当預増減	▲ 22,000		15,400		7,100	
当座預金残高	3,470,300		3,485,700		3,492,800	
準備預金残高	3,120,100					
積み終了先	3,116,300					
超過準備	3,115,700					
非準備預金先	350,200					
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	99.38%	日数	22.58%		

※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

2017/5/22	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	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.085	0.045	0.010	19,678.28	87.52	111.28-29	111.30-31
T/N	▲ 0.010	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.026				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.130	▲ 0.126						
6M							▲ 0.129	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.205						
									日付	5/15	5/16	5/17	5/18	5/19
									日銀当預残	3,475,900	3,497,200	3,505,000	3,482,500	3,492,300
									準備預金残	3,141,600	3,119,300	3,143,200	3,135,900	3,131,700
									マネタリーベース	4,518,800	4,538,800	4,546,000	4,523,400	4,533,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.048%	▲ 0.051%	▲ 0.052%	▲ 0.051%
									コール市場残高	92,190	92,268	91,467	91,507	94,063
									うち無担	69,389	72,477	71,145	70,259	73,554
									うちO/N	45,568	47,029	46,415	45,148	47,067
									うち有担	22,801	19,791	20,322	21,248	20,509

## ●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	業分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/5/24			10,810	2,812	▲ 0.001		0.001	52.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/5/24			10,497	3,005	0.003		0.003	83.1
国債買入(物債連動債)	250	2017/5/24			1,300	250	▲ 0.280		▲ 0.288	80.0
社債等買入	1,000	2017/5/26			4,033	1,000	0.009		0.014	90.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	61,801	2017/5/22	2017/5/23		423	423		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2017年5月23日の予定

*米国4月の新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札(5,500億円、5/25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