

Central Daily Market Report

2017年5月23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23日		2017年5月24日		2017年5月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 900		▲ 1,000	
財政	1,800		▲ 1,500		▲ 5,000	
資金過不足	1,600		▲ 2,400		▲ 6,000	
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	4,100		6,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
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			200			
国債補完供給	▲ 100	500		100		
当預増減	16,000		3,600		▲ 6,000	
当座預金残高	3,486,300		3,489,900		3,483,900	
準備預金残高	3,111,900					
積み終了先	3,108,800		5月24日以降の残り所要積立額		積数 15,300	
超過準備	3,108,600		1日平均		700	
非準備預金先	374,400					
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	99.49%	日数	25.81%		

※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

2017/5/23	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.086	0.040	▲ 0.005	19,613.28	▲ 65.00	110.92-94	111.19-22
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.020	▲ 0.031				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.039				-	▲ 0.099						
3W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.021				-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.130	▲ 0.126						
6M							▲ 0.130	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.205						
									日付	5/16	5/17	5/18	5/19	5/22
									日銀当預残	3,497,200	3,505,000	3,482,500	3,492,300	3,470,300
									準備預金残	3,119,300	3,143,200	3,135,900	3,131,700	3,120,100
									マネタリーベース	4,538,800	4,546,000	4,523,400	4,533,100	4,510,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.051%	▲ 0.052%	▲ 0.051%	▲ 0.051%
									コール市場残高	92,268	91,467	91,507	94,063	90,257
									うち無担	72,477	71,145	70,259	73,554	69,538
									うちO/N	47,029	46,415	45,148	47,067	43,211
									うち有担	19,791	20,322	21,248	20,509	20,719

●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)
流動性供給	238	-	5,500	2017/5/25		19,429.0	5,468.00		▲ 0.0030%	39.1937%		▲ 0.0040%	

●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)	11,801	2017/5/23	2017/5/24		108	108		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2017/5/25	2017/6/2	1.41	0	0				

●2017年5月24日の予定

*黒田日銀総裁、2017年国際コンファランス「金融政策：教訓と課題」にて講演	*米国4月の中古住宅販売
*月例経済報告	*交付税特別会計借入
*3月の景気動向指数改訂状況	(10,500億円、6/2借入)

◆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