

Central Daily Market Report

2017年5月24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24日		2017年5月25日		2017年5月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,000		0	
財政	▲ 800		▲ 3,300		13,000	
資金過不足	▲ 1,700		▲ 4,300		13,000	
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						
国債買入	6,100				10,300	
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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	1,000	
E T F買入	200		500			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	4,200		▲ 4,100		24,300	
当座預金残高	3,490,500		3,486,400		3,510,700	
準備預金残高	3,125,300					
積み終了先	3,122,300		5月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,122,300		積数		12,200	
非準備預金先	365,200		1日平均		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	99.59%	日数	29.03%		

※2017年5月16日から各計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

2017/5/24	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.083	0.045	0.005	19,742.98	129.70	111.95-96	111.93-94
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.037				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.098						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.127	▲ 0.126						
6M							▲ 0.129	▲ 0.176						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.205						
									日付	5/17	5/18	5/19	5/22	5/23
									日銀当預残	3,505,000	3,482,500	3,492,300	3,470,300	3,486,300
									準備預金残	3,143,200	3,135,900	3,131,700	3,120,100	3,111,900
									マネタリーベース	4,546,000	4,523,400	4,533,100	4,510,500	4,526,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.052%	▲ 0.051%	▲ 0.051%	▲ 0.037%
									コール市場残高	91,467	91,507	94,063	90,257	95,579
									うち無担	71,145	70,259	73,554	69,538	73,771
									うちO/N	46,415	45,148	47,067	43,211	46,221
									うち有担	20,322	21,248	20,509	20,719	21,808

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/6/2	2017/11/30	135,639.0	10,500.09		0.0000%	7.7939%		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	応募総額(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	2017/5/26			12,807	2,805	0.009		0.009	99.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/5/26			11,289	3,005	0.007		0.008	24.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/26			10,921	4,506	0.006		0.007	18.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,801	2017/5/24	2017/5/25		97	97		▲ 0.500	▲ 0.500	
共通担保資金供給(本店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2017/5/24	2017/5/25		28	28				

●2017年5月25日の予定

*櫻井日銀審議委員、佐賀県金融経済懇談会にて *英国1-3月期のGDP改定値	*国庫短期証券(685回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/29発行)	*40年利付国債入札 (5,000億円、5/29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お客様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