

Central Daily Market Report

2017年5月25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25日		2017年5月26日		2017年5月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 700			0
財政	▲ 3,500		11,400			▲ 3,000
資金過不足	▲ 4,600		10,700			▲ 3,000
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					2,700	▲ 2,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,400			
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100	1,000	▲ 100		
ETF買入	500					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 4,500		21,700			▲ 2,900
当座預金残高	3,486,000		3,507,700			3,504,800
準備預金残高	3,125,500					
積み終了先	3,122,700				5月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,122,500				積数	9,200
非準備預金先	360,500				1日平均	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	99.69%	日数	32.26%		

※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

2017/5/25	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.083	0.045	0.000	19,813.13	70.15	111.54-55	111.82-84	
T/N			▲ 0.013				-	▲ 0.065							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.026				-	▲ 0.095							
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.097							
3W							-	▲ 0.100							
1M			0.015				-	▲ 0.102							
3M							▲ 0.129	▲ 0.124							
6M							▲ 0.129	▲ 0.176							
1Y							▲ 0.154	▲ 0.205							
										日付	5/18	5/19	5/22	5/23	5/24
										日銀当預残	3,482,500	3,492,300	3,470,300	3,486,300	3,490,500
										準備預金残	3,135,900	3,131,700	3,120,100	3,111,900	3,125,300
										マネタリーベース	4,523,400	4,533,100	4,510,500	4,526,600	4,531,700
										無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.051%	▲ 0.051%	▲ 0.037%	▲ 0.054%
										コール市場残高	91,507	94,063	90,257	95,579	88,487
										うち無担	70,259	73,554	69,538	73,771	66,779
										うちO/N	45,148	47,067	43,211	46,221	38,412
										うち有担	21,248	20,509	20,719	21,808	21,708

●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	685	-	44,000	2017/5/29	2017/8/28	180,004.0	39,904.5	100.0295	▲ 0.1182%	93.6292%	100.0301	▲ 0.1206%	4,095.0
40年利付国債	10	0.90%	5,000	2017/5/29	2057/3/20	14,317.0	4,997.00		0.9650%	5.1671%			

●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	2017/5/29	2017/6/12		2,680	2680				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	17,355	2017/5/25	2017/5/26		128	128		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年5月26日の予定

*4月全国・5月都都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想：全 国(4月)前年同月比(除く生鮮)：+0.4%
 市場予想：東京都都区部(5月)前年同月比(除く生鮮)：+0.0%
 *4月の企業向けサービス価格指数

*米国1-3月期のGDP改定値
 *米国4月の耐久財新規受注

◆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