

# Central Daily Market Report

2017年5月26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26日		2017年5月29日		2017年5月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		600		1,000	
財政	10,800		▲ 8,300		2,000	
資金過不足	10,000		▲ 7,700		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			2,700	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					5,000	
国債買入	10,400				7,500	
CP等買入		▲ 400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000	▲ 100		▲ 100		
E T F買入			400			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	20,800		▲ 7,600		15,500	
当座預金残高	3,506,800		3,499,200		3,514,700	
準備預金残高	3,158,300					
積み終了先	3,157,900				5月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,157,100				積数	5,900
非準備預金先	348,500				1日平均	300
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	99.80%	日数	41.94%		

※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

2017/5/26	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	▲ 0.055				-	▲ 0.064	0.035	▲ 0.010	19,686.84	▲ 126.29	111.74-75	111.24-25
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.061						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.094						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.095						
3W			0.000				-	▲ 0.099						
1M			0.001				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.130	▲ 0.123						
6M							▲ 0.130	▲ 0.172						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.205						
									日付	5/19	5/22	5/23	5/24	5/25
									日銀当預残	3,492,300	3,470,300	3,486,300	3,490,500	3,486,000
									準備預金残	3,131,700	3,120,100	3,111,900	3,125,300	3,125,500
									マネタリーベース	4,533,100	4,510,500	4,526,600	4,531,700	4,528,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.051%	▲ 0.037%	▲ 0.054%	▲ 0.055%
									コール市場残高	94,063	90,257	95,579	88,487	92,155
									うち無担	73,554	69,538	73,771	66,779	71,305
									うちO/N	47,067	43,211	46,221	38,412	41,465
									うち有担	20,509	20,719	21,808	21,708	20,850

## ●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	5,000	2017/5/30			14,880	5,000	0.000		0.001	52.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/30			11,463	4,507	▲ 0.009		▲ 0.008	87.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/5/30			4,580	2,006	▲ 0.010		▲ 0.009	74.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/5/30			2,812	1,003	▲ 0.010		▲ 0.008	89.7
CP等買入	2,500	2017/5/31			8,000	2,500	▲ 0.010		▲ 0.008	19.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,363	2017/5/26	2017/5/29		220	220		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2017年5月27日の予定

\*黒田日銀総裁、日本金融学会にて講演

## ●2017年5月29日の予定

\*New York祝日(Memorial Day) \*London祝日(Spring Bank Holiday)

◆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