

# Central Daily Market Report

2017年5月29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29日		2017年5月30日		2017年5月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500	▲ 200				300
財政	▲ 8,700		4,900			3,400
資金過不足	▲ 8,200		4,700			3,700
<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						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入			7,900			
CP等買入		▲ 500		▲ 400	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	400		500			
国債補充供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 8,300		17,900			6,200
当座預金残高	3,498,500		3,516,400			3,522,600
準備預金残高	3,146,000					
積み終了先	3,145,400				5月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,145,400				積数	5,200
非準備預金先	352,500				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	99.83%	日数	45.16%		

※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

2017/5/29	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	▲ 0.061				-	▲ 0.071	0.035	0.000	19,682.57	▲ 4.27	111.25-27	111.29-31
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.094						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.130	▲ 0.123						
6M							▲ 0.130	▲ 0.172						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.203						
									日付	5/22	5/23	5/24	5/25	5/26
									日銀当預残	3,470,300	3,486,300	3,490,500	3,486,000	3,506,800
									準備預金残	3,120,100	3,111,900	3,125,300	3,125,500	3,158,300
									マネタリーベース	4,510,500	4,526,600	4,531,700	4,528,300	4,549,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.037%	▲ 0.054%	▲ 0.055%	▲ 0.055%
									コール市場残高	90,257	95,579	88,487	92,155	94,333
									うち無担	69,538	73,771	66,779	71,305	71,865
									うちO/N	43,211	46,221	38,412	41,465	41,627
									うち有担	20,719	21,808	21,708	20,850	22,468

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	18,416	2017/5/29	2017/5/30		182	182		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2017年5月30日の予定

*4月の完全失業率(市場予想:2.8%)	*米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*4月の有効求人倍率(市場予想:1.46倍)	*米国4月の個人所得・消費支出
*4月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲0.7%)	*米国5月のCB消費者信頼感指数
*4月の商業動態統計速報	*2年利付国債入札(22,000億円、6/15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