Central Daily Market Report

2017年5月30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30日 需給速報		2017年5月31日 需給予想		2017年6月1日 当社予想	
銀行券	▲ 200		200		0	
財政	4,000		▲ 500		▲ 18,000	
資金過不足	3,800		▲ 300		▲ 18,000	
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	5,000					
国債買入	7,900					
CP等買入		▲ 400	2,500	▲ 1,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	500		900			
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	16,700		2,400		▲ 18,000	

当座預金残高	3,515,200	3,517,600	3,499,600
準備預金残高	3,146,700		
積み終了先	3,146,100		
超過準備	3,146,100		
非準備預金先	368,500		

5月31日以降の残り所要積立額	
積数	4,600
1日平均	300

積み期間（5/16～6/15）の所要準備額			2,990,100
準備預金進捗率	実績	99.85%	日数 48.39%

※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。

●2017年5月30日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比5,000億円増の314兆7,000億円(当座預金残高見込みは351兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・外銀・証券業態より▲0.08～▲0.06%、地銀業態より▲0.075～▲0.04%での調達となった。一巡後は、散発的に出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC取引はT/N(5/31-6/1)が▲0.085～▲0.075%程度、S/N(6/1-6/2)が▲0.080～▲0.070%程度の出合い。S/Nは月末初を越すことで再び資金ニーズが多く見られ、レート水準を戻して上げる動きとなった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では5Y126～131、10Y336～346、20Y160、30Y50～54、40Y9等にビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/Nは、小幅上昇した。アウトライト市場は、動意なく閑散ながらも、3M物で▲0.13%、6M物で▲0.135%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。CP発行市場は、ノンバンク、石油業態等から大型発行が実施され、発行総額は1,900億円程度とやや膨らんだ。発行レートは0%近辺となった。

●短期金融市場関連指標

2017/5/30	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.061				－	▲ 0.077
T/N	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.035				－	▲ 0.082
S/N							－	－
1W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.049				－	▲ 0.092
2W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.050				－	▲ 0.093
3W							－	▲ 0.098
1M			▲ 0.047				－	▲ 0.126
3M							▲ 0.130	▲ 0.121
6M							▲ 0.129	▲ 0.169
1Y							▲ 0.149	▲ 0.200

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.035	0.000	19,677.85	▲ 4.72	111.19-21	111.07-09

日付	5/23	5/24	5/25	5/26	5/29
日銀当預残	3,486,300	3,490,500	3,486,000	3,506,800	3,498,500
準備預金残	3,111,900	3,125,300	3,125,500	3,158,300	3,146,000
マネタリーベース	4,526,600	4,531,700	4,528,300	4,549,800	4,541,000
無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.054%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.061%
コール市場残高	95,579	88,487	92,155	94,333	90,000
うち無担	73,771	66,779	71,305	71,865	68,033
うちO/N	46,221	38,412	41,465	41,627	38,303
うち有担	21,808	21,708	20,850	22,468	21,967

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
2年利付国債	377	0.10%	22,000	2017/6/15	2019/6/15	100,769.0	19,931.0	100.5200	▲0.1590%	57.7115%	100.5260	▲0.1620%	2,060.0
預保借入(再生)	－	－	900	2017/6/9	2018/6/8	7,370.0	900.00		0.0000%	16.2450%		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）	44,291	2017/5/30	2017/5/31		334	334		▲0.600	▲0.600	

●2017年5月31日の予定

*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
（市場予想：前月比＋4.3%）
*4月の住宅着工統計
*米国ベージュブック
*米国5月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値
*交付税特別会計借入
（10,500億円、6/9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。
◆本資料は何ら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論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