Central Daily Market Report

2017年5月31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31日 需給速報		2017年6月1日 需給予想		2017年6月2日 当社予想	
銀行券	200		0		0	
財政	▲ 600		▲ 12,900		▲ 35,000	
資金過不足	▲ 400		▲ 12,900		▲ 35,000	
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					8,800	
CP等買入	2,500	▲ 1,000		▲ 200		
貸出支援基金(成)					8,600	▲ 800
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	900		100			
国債補完供給	▲ 600	300		600		
当預増減	1,700		▲ 12,400		▲ 18,400	

当座預金残高	3,516,900	3,504,500	3,486,100
準備預金残高	3,147,000		
積み終了先	3,146,500	6月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,146,400	積数	4,100
非準備預金先	369,900	1日平均	300
積み期間（5/16～6/15）の所要準備額			2,990,400
準備預金進捗率	実績 99.86%	日数	51.61%

※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31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4,000億円増の315兆1,000億円(当座預金残高見込みは351兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・外銀・証券業態より▲0.08～▲0.07%、地銀業態より▲0.075～▲0.045%での調達となった。月末要因からビッドを控える先もあり、出合い水準は、昨日と比べやや低下しての取引となった。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(6/1-6/2)が▲0.08～▲0.07%程度、S/N(6/2-6/5)が▲0.075～▲0.065%程度の出合い。S/Nは引き続きレート水準に変化は無く、横ばい推移となっている。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは、低位横ばいで推移した。CP発行市場は400億円弱の発行があった。発行、償還ともに少なく閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2017/5/31	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	▲ 0.065				－	▲ 0.078
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.073
S/N							－	－
1W			▲ 0.030				－	▲ 0.085
2W			▲ 0.018				－	▲ 0.087
3W			▲ 0.005				－	▲ 0.094
1M			▲ 0.050				－	▲ 0.121
3M							▲ 0.128	▲ 0.119
6M							▲ 0.128	▲ 0.166
1Y							▲ 0.145	▲ 0.198

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)
0.040	0.005	19,650.57	▲ 27.28	110.84-86	110.95-96

日付	5/24	5/25	5/26	5/29	5/30
日銀当預残	3,490,500	3,486,000	3,506,800	3,498,500	3,515,200
準備預金残	3,125,300	3,125,500	3,158,300	3,146,000	3,146,700
マネタリーベース	4,531,700	4,528,300	4,549,800	4,541,000	4,557,800
無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.061%	▲0.061%
コール市場残高	88,487	92,155	94,333	90,000	93,043
うち無担	66,779	71,305	71,865	68,033	71,401
うちO/N	38,412	41,465	41,627	38,303	42,114
うち有担	21,708	20,850	22,468	21,967	21,642

●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)
交付税特会	－	－	10,500	2017/6/9	2017/12/6	151,262.0	10,500.20		0.0000%	6.9840%		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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	2,800	2017/6/2			8,916	2,801	0.006		0.007	74.7
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,000	2017/6/2			9,144	3,004	0.006		0.006	57.6
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,000	2017/6/2			7,279	2,019	0.003		0.005	10.6
国債買入（残存期間25年超）	1,000	2017/6/2			3,253	1,003	0.002		0.004	80.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	41,271	2017/5/31	2017/6/1		543	543		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/6/2	2017/6/8	1.41	0	0				

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円・百万ドル）	貸付先数
成長基盤強化	本則第28回	2017/6/2	2021/6/2	0	8,622	46
成長基盤強化	ABL等特則第24期	2017/6/5	2021/6/4	0	14	4
成長基盤強化	小口特則第21期	2017/6/2	2021/6/2	0	22.90	18
成長基盤強化	米ドル特則第20期	2017/6/2	2018/6/4		4,000	37
成長基盤強化	米ドル特則第16期(借り換え)	2017/6/2	2018/6/4		115	15
成長基盤強化	米ドル特則第12期(借り換え)	2017/6/2	2018/6/4		42	13
成長基盤強化	米ドル特則第8期(借り換え)	2017/6/2	2018/6/4		1,866	24

●2017年6月1日の予定

*原田日銀審議委員、 岐阜県金融経済懇談会にて講演　*1-3月期の法人企業統計調査季報　*国庫短期証券（686回）入札（3ヶ月、44,000億円、6/5発行）
*米国4月の建設支出　*米国5月のISM製造業景況指数　*10年利付国債入札（23,000億円、6/20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