

# Central Daily Market Report

2017年6月2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6月2日		2017年6月5日		2017年6月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		1,200		1,000	
財政	▲ 49,300		3,300		1,000	
資金過不足	▲ 49,100		4,500		2,000	
<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			2,000	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					5,000	
国債買入	9,100				11,300	
CP等買入		▲ 100		▲ 900		
貸出支援基金(成)	8,600	▲ 3,800		▲ 100		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 35,100		3,800		18,300	
当座預金残高	3,469,000		3,472,800		3,491,100	
準備預金残高	3,123,500					
積み終了先	3,122,800					6月5日以降の残り所要積立額
超過準備	3,122,800					積数 1,600
非準備預金先	345,500					1日平均 100
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	99.95%	日数	64.52%		

※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

2017/6/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.059				-	▲ 0.074	0.049	▲ 0.001	20,177.28	317.25	111.43-45	111.56-58																																																						
T/N			▲ 0.003				-	▲ 0.069																																																												
S/N							-	-																																																												
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.081																																																												
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.083																																																												
3W							-	▲ 0.091																																																												
1M							-	▲ 0.117																																																												
3M							▲ 0.117	▲ 0.116																																																												
6M							▲ 0.124	▲ 0.166																																																												
1Y							▲ 0.136	▲ 0.198																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>日付</th> <th>5/26</th> <th>5/29</th> <th>5/30</th> <th>5/31</th> <th>6/1</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>日銀当預残</td> <td>3,506,800</td> <td>3,498,500</td> <td>3,515,200</td> <td>3,516,900</td> <td>3,504,100</td> </tr> <tr> <td>準備預金残</td> <td>3,158,300</td> <td>3,146,000</td> <td>3,146,700</td> <td>3,147,000</td> <td>3,151,800</td> </tr> <tr> <td>マネタリーベース</td> <td>4,549,800</td> <td>4,541,000</td> <td>4,557,800</td> <td>4,559,300</td> <td>4,546,600</td> </tr> <tr> <td>無担O/N加重平均</td> <td>▲ 0.055%</td> <td>▲ 0.061%</td> <td>▲ 0.061%</td> <td>▲ 0.065%</td> <td>▲ 0.060%</td> </tr> <tr> <td>コール市場残高</td> <td>94,333</td> <td>90,000</td> <td>93,043</td> <td>91,442</td> <td>86,353</td> </tr> <tr> <td>うち無担</td> <td>71,865</td> <td>68,033</td> <td>71,401</td> <td>68,648</td> <td>63,898</td> </tr> <tr> <td>うちO/N</td> <td>41,627</td> <td>38,303</td> <td>42,114</td> <td>42,639</td> <td>38,289</td> </tr> <tr> <td>うち有担</td> <td>22,468</td> <td>21,967</td> <td>21,642</td> <td>22,794</td> <td>22,455</td> </tr> </tbody> </table>															日付	5/26	5/29	5/30	5/31	6/1	日銀当預残	3,506,800	3,498,500	3,515,200	3,516,900	3,504,100	準備預金残	3,158,300	3,146,000	3,146,700	3,147,000	3,151,800	マネタリーベース	4,549,800	4,541,000	4,557,800	4,559,300	4,546,600	無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.061%	▲ 0.061%	▲ 0.065%	▲ 0.060%	コール市場残高	94,333	90,000	93,043	91,442	86,353	うち無担	71,865	68,033	71,401	68,648	63,898	うちO/N	41,627	38,303	42,114	42,639	38,289	うち有担	22,468	21,967	21,642	22,794	22,455
日付	5/26	5/29	5/30	5/31	6/1																																																															
日銀当預残	3,506,800	3,498,500	3,515,200	3,516,900	3,504,100																																																															
準備預金残	3,158,300	3,146,000	3,146,700	3,147,000	3,151,800																																																															
マネタリーベース	4,549,800	4,541,000	4,557,800	4,559,300	4,546,600																																																															
無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.061%	▲ 0.061%	▲ 0.065%	▲ 0.060%																																																															
コール市場残高	94,333	90,000	93,043	91,442	86,353																																																															
うち無担	71,865	68,033	71,401	68,648	63,898																																																															
うちO/N	41,627	38,303	42,114	42,639	38,289																																																															
うち有担	22,468	21,967	21,642	22,794	22,455																																																															

## ●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	2017/6/6			14,920	5,005	0.000		0.001	13.1
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2017/6/6			5,325	1,005	0.045		0.049	66.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/6/6			8,299	2,805	0.004		0.006	20.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/6/6			10,879	3,006	0.002		0.003	5.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/6/6			11,046	4,510	0.001		0.002	61.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,466	2017/6/2	2017/6/5		134	134		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/6/2	2017/6/5		1	1		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2017年6月5日の予定

*6月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国5月のISM非製造業景況指数 *米国5月のFRB労働市場情勢指数
-------------------	---

◆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