

●資金需給

| 単位：億円                   | 2017年5月1日 | 2017年5月2日      | 2017年5月8日 |
|-------------------------|-----------|----------------|-----------|
|                         | 需給速報      | 需給予想           | 当社予想      |
| 銀行券                     | ▲ 2,500   | ▲ 1,200        | 6,000     |
| 財政                      | ▲ 9,100   | ▲ 8,100        | ▲ 39,000  |
| 資金過不足                   | ▲ 11,600  | ▲ 9,300        | ▲ 33,000  |
| 金融調節                    | スタート      | エンド            | スタート      |
| 貸出                      |           |                |           |
| 全店共通                    | 2,600     | ▲ 2,700        | 1,700     |
| 国債買現                    |           |                | ▲ 1,500   |
| 国債売現                    |           |                |           |
| 国庫短期証買入                 |           | 5,000          |           |
| 国債買入                    |           |                | 10,600    |
| CP等買入                   |           | ▲ 300          |           |
| 貸出支援基金(成)               |           |                |           |
| 貸出支援基金(貸)               |           |                |           |
| 被災地支援                   |           |                |           |
| 社債等買入                   |           |                |           |
| E T F 買入                |           |                |           |
| 国債補完供給                  | ▲ 1,800   | 2,400          | 1,800     |
| 当預増減                    | ▲ 11,400  | ▲ 2,500        | ▲ 22,200  |
| 当座預金残高                  | 3,553,700 | 3,551,200      | 3,529,000 |
| 準備預金残高                  | 3,186,200 |                |           |
| 積み終了先                   | 2,688,300 | 5月2日以降の残り所要積立額 |           |
| 超過準備                    | 2,688,300 | 積数             | 2,800     |
| 非準備預金先                  | 367,500   | 1日平均           | 200       |
| 積み期間 (4/16~5/15) の所要準備額 |           |                | 2,221,800 |
| 準備預金進捗率                 | 実績        | 99.87%         | 日数        |
|                         |           |                | 53.33%    |

●短期金融市場関連指標

| 2017/5/1 | 無担(速報)  |       |         | 有担(速報) |    |    | 短国      | 東京<br>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 | ▲ 0.074 |        |    |    | -       | ▲ 0.092     |
| T/N      |         |       | ▲ 0.045 |        |    |    | -       | ▲ 0.095     |
| S/N      |         |       |         |        |    |    | -       | -           |
| 1W       | ▲ 0.055 | 0.000 | ▲ 0.030 |        |    |    | -       | ▲ 0.109     |
| 2W       |         |       | ▲ 0.040 |        |    |    | -       | ▲ 0.110     |
| 3W       |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.111     |
| 1M       | ▲ 0.025 | 0.001 | ▲ 0.019 |        |    |    | -       | ▲ 0.115     |
| 3M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.135 | ▲ 0.130     |
| 6M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.146 | ▲ 0.182     |
| 1Y       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.147 | ▲ 0.211     |

| 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)   |
| 0.010     | 0.000     | 19,310.52 | 113.78    | 111.30-31 | 111.83-85 |
| 日付        | 4/24      | 4/25      | 4/26      | 4/27      | 4/28      |
| 日銀当預残     | 3,536,500 | 3,553,600 | 3,565,900 | 3,554,200 | 3,565,100 |
| 準備預金残     | 3,168,400 | 3,174,300 | 3,180,300 | 3,170,400 | 3,182,500 |
| マネタリーベース  | 4,581,400 | 4,600,400 | 4,615,600 | 4,607,300 | 4,621,800 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.070%   | ▲0.074%   | ▲0.074%   | ▲0.075%   | ▲0.074%   |
| コール市場残高   | 89,419    | 86,789    | 86,680    | 82,404    | 81,143    |
| うち無担      | 69,975    | 66,654    | 67,239    | 63,605    | 61,184    |
| うちO/N     | 41,050    | 37,517    | 37,132    | 33,320    | 34,084    |
| うち有担      | 19,444    | 20,135    | 19,441    | 18,799    | 19,959    |

●入札結果

| 名称     | 回号  | 表面<br>利率 | 発行<br>予定額 | 発行日      | 償還日      | 応募額<br>(億円) | 募入額<br>(億円) | 募入<br>最低額 | 募入最高利回・利<br>回較差 | 案分率      | 募入<br>平均価格 | 募入平均利回・利<br>回較差 | 第1非価格<br>競争入札(億円) |
|--------|-----|----------|-----------|----------|----------|-------------|-------------|-----------|-----------------|----------|------------|-----------------|-------------------|
| 国庫短期証券 | 680 | -        | 44,300    | 2017/5/8 | 2017/8/7 | 142,026.0   | 40,082.50   | 100.0325  | ▲0.1303%        | 74.9697% | 100.0348   | ▲0.1395%        | 4,217.0           |

●オペ結果

| 種類                        | オファー額<br>(億円・<br>百万ドル) | スタート日    | エンド日      | 貸付<br>利率 | 応札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 落札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 按分レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 全取レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 平均落札レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 按分<br>比率 |
|---------------------------|------------------------|----------|-----------|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|----------|
| 共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞      | 8,000                  | 2017/5/8 | 2017/5/22 |          | 1,740                 | 1,740                 |                         |                         |                           |          |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下)         | 2,800                  | 2017/5/8 |           |          | 10,287                | 2,804                 | 0.001                   |                         | 0.003                     | 28.0     |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下)         | 3,000                  | 2017/5/8 |           |          | 13,080                | 3,004                 | 0.002                   |                         | 0.004                     | 10.9     |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下)        | 4,500                  | 2017/5/8 |           |          | 14,446                | 4,507                 | 0.001                   |                         | 0.002                     | 15.9     |
| 国債買入(物価連動債)               | 250                    | 2017/5/8 |           |          | 1,339                 | 251                   | ▲0.090                  |                         | ▲0.188                    | 26.7     |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 35,863                 | 2017/5/1 | 2017/5/2  |          | 1,784                 | 1,784                 |                         | ▲0.600                  | ▲0.600                    |          |

●2017年5月2日の予定

|                                                                                                                             |                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| *黒田日銀総裁、アジア開発銀行研究所・ペンシルバニア大学共催<br>グローバル・シンクタンク・サミットにて講演<br>*4月実績/5月見込み財政資金対民間収支<br>*金融政策決定会合議事要旨(3月15、16日分)<br>*4月のマネタリーベース | *米国FOMC(1日目)<br>*流動性供給入札<br>(2,000億円、5/9発行) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|

◆本資料は信頼できるとさ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