

Central Daily Market Report

2017年5月15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15日		2017年5月16日		2017年5月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,900		1,400			0
財政	▲ 32,500		2,700			2,000
資金過不足	▲ 30,600		4,100			2,000
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	2,600	▲ 2,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入			7,500			
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
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	▲ 800	900		800		
当預増減	▲ 30,900		22,300			2,000
当座預金残高	3,475,900		3,498,200			3,500,200
準備預金残高	3,141,600					
積み終了先	2,628,500				5月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,628,500				積数	2,989,500
非準備預金先	334,300				1日平均	96,400
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	0.00%	日数	0.00%		

●2017年5月15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1兆6,000億円減少の262兆6,000億円(当座預金残高見込みは347兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは国内勢の幅広い業態から▲0.04~▲0.035%の調達希望で始まった。積み最終日による取り調整の動きから、一部で取り上がりの動きも見られ、立ち上がりは▲0.04~▲0.03%の出会い。一巡後も調達ニーズは強く、▲0.035%の出会いが見られた。ターム物は引き続き閑散であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(5/16-5/17)が▲0.095~▲0.090%程度、S/N(5/17-5/18)が▲0.095~▲0.090%程度の出合い。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、343、20Y160等にビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先T/Nは低水準で推移。市場は、動意なく閑散。3Mと6Mで▲0.134%での出合いが見られた程度。

<CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。市場は、発行案件乏しく閑散、発行総額は200億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばいでの落ち着いた取引となった。

2017年5月16日から各係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

2017/5/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.070	0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.072	0.035	▲ 0.005	19,869.85	▲ 14.05	113.26-28	113.64-65
T/N			0.000				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.035				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.106						
3M			0.000				▲ 0.133	▲ 0.129						
6M							▲ 0.134	▲ 0.178						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.207						
									日付	5/8	5/9	5/10	5/11	5/12
									日銀当預残	3,517,600	3,530,700	3,538,300	3,513,700	3,506,800
									準備預金残	3,175,500	3,163,500	3,164,700	3,157,800	3,150,200
									マネタリーベース	4,573,100	4,582,200	4,586,400	4,560,100	4,551,700
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.053%	▲0.042%	▲0.039%	▲0.037%
									コール市場残高	89,304	88,546	91,572	91,935	96,845
									うち無担	66,620	67,651	73,294	71,425	75,555
									うちO/N	40,660	41,919	48,359	45,789	49,497
									うち有担	22,684	20,895	18,278	20,510	21,290

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34424	2017/5/15	2017/5/16		406	406		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	29,984	2017/5/15	2017/5/16		364	364		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第73回	2017/5/19	2018/5/18	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第12回	2017/5/19	2018/5/18	0

●2017年5月16日の予定

*3月の第3次産業活動指数	*米国4月の住宅着工件数 *米国4月の鉱工業生産・設備稼働率 *英国4月の消費者物価指数 *ユーロ圏1-3月期のGDP2次速報	*5年利付国債入札(22,000億円、5/18発行) *国有林野借入(590億円、5/25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