# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貝並而和								
* / + / + 17	2017年	5月17日	20174	₹5月18日	≡	2017年5月19日		
単位:億円	需給	速報	需	給予想	当社予想			
銀行券		600			0	0		
財政		7, 400	4	22, 2	3, 000			
資金過不足		8, 000		<b>2</b> 2, 2	00	3, 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						10, 300		
CP等買入		▲ 100		<b>A</b> 2	200			
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								
国債補完供給	▲ 700	600			700			
当預増減		7, 800	4	<b>▲</b> 21, 7	00		13, 300	
当座預金残高	3,	505, 000	3	, 483, 3	3, 496, 600			
準備預金残高	3,	143, 200						
積み終了先		020, 300		5月18日	日以	降の残り所要積立額		
超過準備	2,	677, 900		積	数		155, 300	
非準備預金先		361, 800		1日平	均	5, 400		
積み期間 (5/16~	6/15) <i>o</i> .	)所要準備	備額			2, 989, 500		
準備預金進捗率	実績		94. 81	% 日	6. 45%			

# ●2017年5月17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1兆円増の314兆3,000億円 (当座預金残高見込みは350兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・ 証券業態より▲0.07~▲0.06%、地銀業態より▲0.04~▲0.03%での調達と なった。一巡後も、同水準で散発的な出合いが見られるなか本日の取引を 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(5/18-5/19)が▲0.095~▲0.085%程度、S/N(5/19-5/22)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。1Y物の入札が実施され、WI取引での▲0.152% の出合いを受けて、入札結果は平均落札利回▲0.1561%・按分落札利回▲ 0.1461%と、事前予想よりやや強めの結果となった。セカンダリー市場でも▲ 0.158~▲0.155%と堅調に推移。一方で、3M▲0.125%、6M▲0.135~▲ 0.125%と、3M物や6M物は共に軟調な推移となった。

#### <CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。市場は、20日発行に係る発行となり、償還総 額800億程度に対し、幅広い業態からの発行案件が見られ、発行総額は 1,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは低位横ばいで推移。CP等買入オ ペがオファー額2,500億円で実施され、入札結果は平均落札レート0.005%・ 按分落札レート▲0.010%と、前回比(平均▲0.002%按分▲0.005%)で平均 は上昇、按分は低下する結果となった。

# ※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

2017/5/17	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	売買参考統計值	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.093
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.090
S/N							-	-
1W	▲ 0.065	▲ 0.030	▲ 0.059				_	▲ 0.095
2W	▲ 0.040	▲ 0.034	▲ 0.038				-	▲ 0.101
3W							_	▲ 0.105
1M							_	▲ 0.109
3M							▲ 0.125	▲ 0.128
6M							▲ 0.127	▲ 0.178
1Y		·					▲ 0.153	▲ 0.207

JGB新発10年債					日経平均株価				ドル/円				
直記	丘値	前日比		15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)			
0.0	)39	<b>A</b> (	0.001 1		9,814.88		104.94		112.69-70	112.44-45			
日付			5/1	0	5/11		5/12		5/15	5/16			
日銀当	日銀当預残		3,538,	300	3,513,700		3,506,800		3,475,900	3,497,200			
準備預金残		3,164,	700	3,157,800		3,150,200		3,141,600	3,119,300				
マネタ	マネタリーベース		4,586,400		4,560,100		4,551,700		4,518,800	4,538,800			
無担O	無担O/N加重平均		▲0.042%		▲0.039%		▲0.037%		▲0.033%	▲0.048%			
コール	コール市場残高		91,572		91,935		96,845		92,190	92,268			
	うち無担		73,294		71,425		75,555		69,389	72,477			
	3	50/N	48,	359	45,7	89	49,497		45,568	47,029			
うち有担		18,	278	20,5	10	21,29	90	22,801	19,791				

# ●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)
国庫短期証券	683	_	23,000	2017/5/22	2018/5/21	97,014.5	20,941.80	100.1460	▲0.1461%	89.8648%	100.1560	▲0.1561%	2,058.0

# ●オペ結果

稚類	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	2017/5/19			11,013	2,804	0.007		0.007	76.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/5/19			8,789	3,004	0.003		0.004	78.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/19			12,335	4,510	0.002		0.003	53.6
CP等買入	2,500	2017/5/22			9,398	2,495	▲0.010		0.005	10.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,801	2017/5/17	2017/5/18		700	700		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10.000	2017/5/17	2017/5/18		15	15		▲0.500	▲0.500	

# ●2017年5月18日の予定

\*1-3月期のGDP1次速報 (市場予想:前期比年率+1.7%) \*3月の石油等消費動態統計

\*国庫短期証券(684回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/22発行)

\*20年利付国債入札 (10,000億円、5/22発行) \*交付税特別会計借入 (10,500億円、5/26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