Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

	貝亚希和							
	¥ /	2018年	5月1日	2018年	5月2日	2018年5月7日		
単位:億円		需給	速報	需給	予想	当社予想		
	銀行券	4	2, 200		100	5, 000		
	財政	A	12, 900	A	11, 600	A	45, 000	
	資金過不足	A	15, 100	A	11, 500	A	40,000	
	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, 400	▲ 1,500				1 2,000	
	国債買現							
	国債売現							
	国庫短期証買入			5, 000				
	国債買入			5, 100				
	CP等買入		▲ 200		▲ 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							
	ETF買入							
Ш	国債補完供給	▲ 200	1, 500		200			
	当預増減		13, 100		1,300		42, 000	
当座	E預金残高	3, 872, 600		3,	871, 300	3, 829, 300		
2	隼備預金残高	3,	405, 100					
	積み終了先	3, 404, 900		5月2日以		降の残り所要積立額		
ΙL	超過準備		404, 900	積数		2, 600		
非準備預金先			467, 500		1日平均	200		
積み	→期間(4/16~	5/15) <i>o</i> .)所要準	備額		3, 008, 500		
準備	請預金進捗率	実績		99. 91%	日数	53. 33%		

●2018年5月1日の市場動向

〈インターバンク市場〉

本日の無担O/N物は引き続き前営業日同様に低調で、立ち上がりは都銀・信託・証券で▲0.086%、地銀業態で▲0.086~▲0.06%の出合いが中心となった。一巡後も調達意欲は弱く、本日の取引を終えた。ターム物は閑散な中、2W物で▲0.05%近辺の出合いが散見された。

〈レポ市場〉

GC T/N(5/2-5/7) は、▲0.10~▲0.065%程度での出合い。本日から決済短縮化によりGC S/Nの取引が基本的に無くなった。銘柄後決め方式での買いは限定的で先決めと後決めで若干のレート差が見られた。個別銘柄では、5Y130~135、10Y336~350、30Y58などにビッドの出入りが目立った。

〈短国市場〉

現先レートT/Nは小幅上昇。アウトライト市場は、短国買入オペが5,000億円 (前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額は15,000億円程度と多かったものの、売り急ぐような動きはなく、平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差▲0.001%と落ち着いた結果となった。マーケットでは3M物が▲0.15~▲0.149%で出合った。

〈CP市場〉

現先レートは低位で推移した。発行市場は月初や連休の谷間ということもあり、案件少なく閑散であった。

ICD新發10年债 日級亚拉姓伍

●短期金融市場関連指標

2018/5/1	無担 (速報)				有担(速報)	短国	サガ値	
単位:%	最低 最高 平均		最低	最高	売買参考統計值			
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.075				-	▲ 0.097
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.110
2W	▲ 0.065	▲ 0.025	▲ 0.050				-	▲ 0.112
3W							-	▲ 0.119
1 M	▲ 0.025	0.380	▲ 0.001				-	▲ 0.129
3M							▲ 0.145	▲ 0.147
6M			·				▲ 0.146	▲ 0.152
1Y							▲ 0.160	▲ 0.161

JGD机光IU平頂					口柱十均休仙				ר /עריז				
直近値 前日		日比	15時時点			前日比		為替(9時)	為替(17時)				
0.0	035 🛕 0.015		0.015	22	22,508.03		40.16		109.31-32	109.47-48			
日付		4/2	:3	3 4/24		4/25		4/26	4/27				
日銀当	4預残		3,860	100	00 3,856,90		3,872,600		3,873,600	3,885,700			
準備預金残			3,379,800		3,377,600		3,394,000		3,388,000	3,408,100			
マネタリーベース		4,947,100		4,945,800		4,963,700		4,968,000	4,983,800				
無担O	無担O/N加重平均		▲0.0	71%	▲0.072%		▲0.072%		▲0.071%	▲0.067%			
コール市場残高		88	,637 84,4		58	8 81,009		76,255	77,827				
うち無担		73,	080	080 69,612		65,350		59,787	56,345				
	うち0/N		43	325	325 39,337		35,000		31,197	27,495			
うち有担		15,	557	557 14,84		15,659		16,468	21,482				

●入札結果

名称 回号 表面 発行 発行日 僕還日 応募額 (使円)	応募額 募入 募入 (億円) 最低額 最高利回	東分率 景へ まから 競	I 非価格 建争入札 (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	2018/5/2			14,965	5,002	▲0.001		0.001	13.6
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/5/2			3,585	506	0.001		0.006	46.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/2			14,710	4,506	▲0.014		▲0.013	95.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2018/5/1	2018/5/2		100	100		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2018/5/1	2018/5/2		100	100		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2018/5/1	2018/5/2		30	30		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月2日の予定

*4月実績/5月見込み財政資金対民間収支

*米国FOMC(2日目)

*国庫短期証券(755回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/7発行)

*4月のマネタリーベース *4月の消費動向調査 *ユーロ圏1-3月期のGDP1次速報

- *流動性供給入札
- (4,000億円、5/7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。

が記し金がらい成びする音画で日間で音でよくながったことできた。 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