

Central Daily Market Report

2018年5月2日(水)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2018年5月2日		2018年5月7日		2018年5月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		3,900		4,000	
財政	▲ 11,500		▲ 33,800		3,000	
資金過不足	▲ 11,400		▲ 29,900		7,000	
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			1,800	▲ 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		▲ 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	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 1,400		▲ 29,900		7,000	
当座預金残高	3,871,200		3,841,300		3,848,300	
準備預金残高	3,402,100					
積み終了先	3,401,900				5月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,401,900				積数	
非準備預金先	469,100				1日平均	
					200	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,009,600	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	70.00%		

●2018年5月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、連休の谷間ということもあり、調達意欲は低調で、立ち上がりは前日同様に、都銀・信託・証券で▲0.086%、地銀業態で▲0.086~▲0.070%の出会いが中心となった。一巡後も調達意欲は弱く、閑散な中で本日の取引を終えた。ターム物はショートターム物で▲0.060~▲0.050%の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(5/2-5/7)は、▲0.08~▲0.065%程度の出会い、T/N(5/7-5/8)は、▲0.09~▲0.05%程度での出会い。資金運用サイドが薄く、引き続きレートは▲0.10%よりも高い水準が続いている。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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.147%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1411%、按分落札利回▲0.1323%と前回債からレートは上昇したものの、概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲0.139~▲0.137%の出会いと底堅く推移した。

<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。

●短期金融市場関連指標

2018/5/2	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.075				-	▲ 0.078	0.040	0.005	22,472.78	▲ 35.25	109.86-88	109.78-79
T/N			0.000				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.065	▲ 0.038	▲ 0.055				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.138	▲ 0.144						
6M							▲ 0.142	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.161						
									日付	4/24	4/25	4/26	4/27	5/1
									日銀当預残	3,856,900	3,872,600	3,873,600	3,885,700	3,872,600
									準備預金残	3,377,600	3,394,000	3,388,000	3,408,100	3,405,100
									マネタリーベース	4,945,800	4,963,700	4,968,000	4,983,800	4,972,800
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.067%	▲0.075%
									コール市場残高	84,458	81,009	76,255	77,827	92,201
									うち無担	69,612	65,350	59,787	56,345	70,575
									うちO/N	39,337	35,000	31,197	27,495	40,833
									うち有担	14,846	15,659	16,468	21,482	21,626

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	755	-	44,200	2018/5/7	2018/8/6	184,533.0	35,810.4	100.0330	▲0.1323%	77.2888%	100.0352	▲0.1411%	8,389.0
流動性供給	261	-	4,000	2018/5/7		14,595.0	3,994.00		▲0.0060%	44.6601%		▲0.0080%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/5/7	2018/5/21		1,802	1,802				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,118	2018/5/2	2018/5/7		146	146		▲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	2018/5/2	2018/5/7		17	17		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月3日の予定

*憲法記念日
*米国3月の貿易収支
*米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国4月のISM非製造業景況指数
*ユーロ圏4月の消費者物価指数速報値

●2018年5月4日の予定

*みどりの日
*米国4月の雇用統計

●2018年5月7日の予定

*5月の日銀当座預金増減要因見込み
*金融政策決定会合議事要旨(3月8・9日分)
*米国3月の消費者信用残高
*London祝日(May Day)

◆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