

# Central Daily Market Report

2018年5月8日(火)  
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8日 需給速報		2018年5月9日 需給予想		2018年5月10日 当社予想	
銀行券	3,100		3,000		2,000	
財政	200		▲ 24,800		▲ 9,000	
資金過不足	3,300		▲ 21,800		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	8,700					
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 100	200		100		
当増減	16,700		▲ 21,900		▲ 7,000	
当座預金残高	3,857,900		3,836,000		3,829,000	
準備預金残高	3,404,700					
積み終了先	3,404,400		5月9日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,404,400		積数		1,400	
非準備預金先	453,200		1日平均		200	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,026,100	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	76.67%		

## ●2018年5月8日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀・信託・地銀・証券から▲0.075%近辺の調達希望で始まった。全般的に調達意欲は旺盛で、立ち上がりは▲0.07%の出合いが中心となった。その後は徐々に取り上がり、▲0.065%の出合いが中心となった。一巡後はオファーが少なく閑散であった。ターム物は引き続きロール案件が中心であった。

### <レポ市場>

GC T+0(5/8-5/9)は、▲0.075~▲0.045%程度の出合い、T/N(5/9-5/10)は、▲0.075~▲0.05%程度での出合い。個別銘柄では、5Y130~135、10Y336~350、30Y-58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は低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は10日発行の応当日であったが、1,800億円程度の償還に対して、発行は800億円程度にとどまった。発行レートは概ね0%近辺が中心であった。本日はCP等買入オファーが2,000億円オファーされた。結果は平均落札レート0.000% 按分落札レート▲0.005%と前回(平均0.002% 按分▲0.005%)と概ね同水準であった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/5/8	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	売買参考計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.064		0.045	0.005	22,508.69	41.53	108.94-95	108.92-94		
T/N			0.000				-	▲ 0.071									
S/N							-	-									
1W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.041				-	▲ 0.088									
2W							-	▲ 0.096									
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.104									
1M							-	▲ 0.116									
3M							▲ 0.137	▲ 0.135									
6M							▲ 0.140	▲ 0.151									
1Y							▲ 0.145	▲ 0.163									
												日付	4/26	4/27	5/1	5/2	5/7
												日銀当預残	3,873,600	3,885,700	3,872,600	3,871,200	3,841,200
												準備預金残	3,388,000	3,408,100	3,405,100	3,402,100	3,374,900
												マネタリーベース	4,968,000	4,983,800	4,972,800	4,971,400	4,937,500
												無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.067%	▲0.075%	▲0.075%	▲0.072%
												コール市場残高	76,255	77,827	92,201	98,399	106,051
												うち無担	59,787	56,345	70,575	74,033	80,124
												うちO/N	31,197	27,495	40,833	43,531	50,672
												うち有担	16,468	21,482	21,626	24,366	25,927

## ●入札結果

名称	回数	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)
10年利付国債	350	0.10%	22,000	2018/5/9	2028/3/20	74,463.0	17,709.0	100.5200	0.0470%	91.9407%	100.5300	0.0460%	4,276.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/5/16	2018/11/15	207,799.0	10,500.12		0.0000%	5.0531%		0.0000%	

## ●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
CP等買入	2,000	2018/5/11			5,846	1,970	▲0.005		0.000	55.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2018/5/8	2018/5/9		3	3		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	70,453	2018/5/8	2018/5/9		28	28		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	33,996	2018/5/8	2018/5/9		61	61		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/5/10	2018/5/17	2.21	0	0				

## ●2018年5月9日の予定

*3月の景気動向指数速報	*米3月の卸売売上高	*国庫短期証券(756回)入札
*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米4月の生産者物価指数	(6ヶ月、23,000億円、5/10発行)
*3月の毎月勤労統計調査速報		

◆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ことがあります。金融商品取引法に基づきお読み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