

Central Daily Market Report

2018年5月9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9日		2018年5月10日		2018年5月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,000		1,500		1,000	
財政	▲ 24,300		▲ 8,600		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 21,300		▲ 7,100		▲ 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			10,500			
CP等買入		▲ 200	▲ 400		2,000	
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				
当預増減	▲ 21,400		3,000		▲ 1,000	
当座預金残高	3,836,500		3,839,500		3,838,500	
準備預金残高	3,375,800					
積み終了先	3,375,600		5月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,375,600		積数		1,200	
非準備預金先	460,700		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	99.96%	日数	80.00%		

●2018年5月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日同様に調達意欲は旺盛で、都銀・信託・地銀・証券から▲0.065%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.06%テイコンの展開で始まった。その後は徐々に取り上がり、▲0.055~▲0.050%の出会いが中心となった。一巡後も同水準の出会いが散見された。ターム物は1W物で▲0.05%近辺の出会いがみられた。

<レポ市場>

GC T+0(5/9-5/10)は、▲0.065~▲0.045%程度の出合い、T/N(5/10-5/11)は、▲0.075~▲0.05%程度での出合い。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は低水準で推移した。アウトライト市場は、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.13~▲0.128%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1294%、按分落札利回▲0.1255%とマーケットの慎重姿勢を反映し、前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.132%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.135%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、商社から大型案件が見られたものの、案件少なく発行総額は1,000億円程度であった(償還総額1,500億円程度)。

●短期金融市場関連指標

2018/5/9	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	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.060	0.045	0.000	22,408.88	▲ 99.81	109.02-03	109.71-72
T/N			0.000				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.049				-	▲ 0.083						
2W							-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.100						
1M			0.000				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.133	▲ 0.133						
6M							▲ 0.132	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.161						
									日付	4/27	5/1	5/2	5/7	5/8
									日銀当預残	3,885,700	3,872,600	3,871,200	3,841,200	3,857,900
									準備預金残	3,408,100	3,405,100	3,402,100	3,374,900	3,403,700
									マネタリーベース	4,983,800	4,972,800	4,971,400	4,937,500	4,951,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.075%	▲ 0.075%	▲ 0.072%	▲ 0.063%
									コール市場残高	77,827	92,201	98,399	106,051	101,918
									うち無担	56,345	70,575	74,033	80,124	77,178
									うちO/N	27,495	40,833	43,531	50,672	47,626
									うち有担	21,482	21,626	24,366	25,927	24,740

●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	756	-	23,000	2018/5/10	2018/11/12	100,378.0	19,174.80	100.0640	▲0.1255%	91.3562%	100.0660	▲0.1294%	3,825.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/5/10			8,147	2,512	0.002		0.004	11.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/10			10,622	3,304	0.006		0.006	59.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/10			15,108	4,511	0.002		0.003	33.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	2,595	2018/5/9	2018/5/10		1	1		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	66,211	2018/5/9	2018/5/10		43	43		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)(注5)	15,013	2018/5/9	2018/5/10		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月10日の予定

*決定会合における主な意見(4月26、27日分)	*英中銀MPC結果発表	*10年物価連動国債入札(4,000億円、5/11発行)
*3月の国際収支	*米国4月の財政収支	
*4月の景気ウォッチャー調査	*米国4月の消費者物価指数	

◆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