

Central Daily Market Report

2018年5月10日(木)

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10日		2018年5月11日		2018年5月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,700		1,600		2,000	
財政	▲ 7,600		▲ 5,300		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 5,900		▲ 3,700		▲ 6,000	
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
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		▲ 400	2,000	▲ 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			700			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	4,000		▲ 900		▲ 8,400	
当座預金残高	3,840,500		3,839,600		3,831,200	
準備預金残高	3,384,500					
積み終了先	3,384,300				5月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,384,300				積数 1,000	
非準備預金先	456,000				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	99.97%	日数	83.33%		

●2018年5月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日同様取り上がる地合いとなり、都銀・信託・地銀・証券から▲0.055~▲0.050%での調達希望で始まった。立ち上がりは▲0.050~▲0.045%の出合いが中心となり、一部▲0.040%にテイクンする動きもみられた。一巡後▲0.050%での落ち着いた出合いが散見された。ターム物は閑散で、ロール案件が中心であった。

<レポ市場>

GC T+0(5/10-5/11)は、▲0.065~▲0.055%程度の出合い、T/N(5/11-5/14)は、▲0.065~▲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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.132%、6M物が▲0.133~▲0.132%、WI取引の3M物が▲0.14%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、償還総額800億円程度に対して、発行総額は1,200億円程度まで膨らんだが、案件少なく閑散なマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2018/5/10	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.058	0.045	0.000	22,497.18	88.30	109.84-86	109.93-95
T/N			0.000				-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.073						
2W	▲ 0.048	▲ 0.010	▲ 0.038				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.096						
1M			0.001				-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.131	▲ 0.133						
6M							▲ 0.132	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.136	▲ 0.160						
									日付	5/1	5/2	5/7	5/8	5/9
									日銀当預残	3,872,600	3,871,200	3,841,200	3,857,900	3,836,500
									準備預金残	3,405,100	3,402,100	3,374,900	3,403,700	3,375,800
									マネタリーベース	4,972,800	4,971,400	4,937,500	4,951,100	4,926,700
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.075%	▲0.072%	▲0.063%	▲0.052%
									コール市場残高	92,201	98,399	106,051	101,918	106,852
									うち無担	70,575	74,033	80,124	77,178	81,372
									うちO/N	40,833	43,531	50,672	47,626	51,520
									うち有担	21,626	24,366	25,927	24,740	25,480

●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)
物価連動10年	23	0.10%	4,000	2018/5/11	2028/3/10	16,057.0	3,996.00	106.3500	▲0.5130%	32.0441%			

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	119,955	2018/5/10	2018/5/11		160	160		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	7,773	2018/5/10	2018/5/11		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月11日の予定

*4月のマネーストック	*5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(757回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/14発行) *エネルギー対策特別会計借入 (8,000億円、5/22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