

Central Daily Market Report

2018年5月11日(金)
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11日		2018年5月14日		2018年5月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,700		1,400		2,000	
財政	▲ 7,100		▲ 10,700		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 5,400		▲ 9,300		▲ 11,000	
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			2,000	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			3,100			
CP等買入	2,000	▲ 100		▲ 300		
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	700					
国債補充供給	▲ 1,000	200		1,000		
当預増減	▲ 3,600		▲ 5,900		▲ 11,000	
当座預金残高	3,836,900		3,831,000		3,820,000	
準備預金残高	3,380,900					
積み終了先	3,380,700		5月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,380,700		積数		300	
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	99.99%	日数	93.33%		

●2018年5月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き取り調整の動きがみられ、週末要因も重なり、一段とレートが上昇する展開となった。立ち上がりは都銀・信託・地銀・証券等、▲0.040~▲0.035%の出合いが中心で、一部では▲0.030%まで取り上がる動きも散見された。一巡後は▲0.060%近辺の出合いが散見された程度であった。ターム物は様子見姿勢が強く閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(5/11-5/14)は、▲0.06~▲0.045%程度の出合い、T/N(5/14-5/15)は、▲0.06~▲0.045%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、3M物の入札が実施された。今回の入札も、引き続きマーケットの慎重姿勢の強まりからレートの上昇も予想された。WI取引において▲0.145~▲0.13%でのやや強めの出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1275%、按分落札利回▲0.1222%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは▲0.13~▲0.121%出合いと按分レート近辺で推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、商社、電気機器、鉄鋼、ゴム、石油業態から大型案件が見られ、1,800億円程度の償還に対して、発行は3,900億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2018/5/11	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	売買参考統計値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.034					-	▲ 0.055	0.040	▲ 0.005	22,758.48	261.30	109.45-46	109.33-35
T/N			0.000					-	▲ 0.059						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.026					-	▲ 0.071						
2W			0.020					-	▲ 0.081						
3W								-	▲ 0.095						
1M								-	▲ 0.109						
3M								▲ 0.123	▲ 0.131						
6M								▲ 0.128	▲ 0.147						
1Y								▲ 0.131	▲ 0.160						
										日付	5/2	5/7	5/8	5/9	5/10
										日銀当預残	3,871,200	3,841,200	3,857,900	3,836,500	3,840,500
										準備預金残	3,402,100	3,374,900	3,403,700	3,375,800	3,384,500
										マネタリーベース	4,971,400	4,937,500	4,951,100	4,926,700	4,929,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.075%	▲ 0.072%	▲ 0.063%	▲ 0.052%	▲ 0.042%
										コール市場残高	98,399	106,051	101,918	106,852	102,684
										うち無担	74,033	80,124	77,178	81,372	78,215
										うちO/N	43,531	50,672	47,626	51,520	48,585
										うち有担	24,366	25,927	24,740	25,480	24,469

●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	757	-	44,100	2018/5/14	2018/8/13	157,664.0	36,209.5	100.0305	▲0.1222%	90.1569%	100.0318	▲0.1275%	7,890.0
エネルギー対策	-	-	8,000	2018/5/22	2019/5/20	124,154.0	7,999.98		0.0000%	6.4437%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/5/14	2018/5/28		1,981	1,981				
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/5/14			6,196	1,916	0.002		0.003	18.0
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/5/14			2,792	703	0.003		0.003	81.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/5/14			1,896	250		▲0.100	▲0.132	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	104,223	2018/5/11	2018/5/14		948	948		▲0.500	▲0.500	

●2018年5月14日の予定

*3月の特定サービス産業動態統計速報	*4月の企業物価指数
--------------------	------------

◆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