

Central Daily Market Report

2018年5月14日(月)
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14日		2018年5月15日		2018年5月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,500		1,300		1,000	
財政	▲ 11,600		▲ 13,200		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 10,100		▲ 11,900		▲ 8,000	
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			12,500			
国債買入	3,100		10,400			
CP等買入		▲ 300		▲ 700		
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		1,000				
当預増減	▲ 6,700		10,300		▲ 8,000	
当座預金残高	3,830,200		3,840,500		3,832,500	
準備預金残高	3,381,300					
積み終了先	3,381,100		5月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,381,100		積数		100	
非準備預金先	448,900		1日平均		100	
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	100.00%	日数	96.67%		

●2018年5月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日に向け、引き続き高止まりの展開であった。立ち上がりは都銀・信託・地銀・証券等、▲0.040~▲0.030%の出合いが中心となった。一巡後は調達ニーズが減退し、▲0.070%近辺までレート低下する動きも見られた。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(5/14-5/15)は▲0.05~▲0.04%程度、T/N(5/15-5/16)は▲0.075~▲0.045%程度で出合いが見られた。積みの最終日にあたるT/Nの取引は、短国買入オペの影響もあり、小幅にレートが低下した。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では5Y131、134、135、10Y340、341、342、348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、短国買入オペが12,500億円(前回比+7500億円)でオファーされた。応札額は3兆円台と膨らんだものの、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差±0.000%と落ち着いた結果となった。マーケットでは3M物が▲0.124~▲0.122%、6M物が▲0.129~▲0.126%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、1,000億円強の償還に対して、500億円弱の発行にとどまり、件数も少なく閑散であった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/5/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.052	0.045	0.005	22,865.86	107.38	109.31-32	109.50-52
T/N			0.000				-	▲ 0.061						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.080						
2W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.088						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.043	▲ 0.040	▲ 0.041				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.123	▲ 0.130						
6M							▲ 0.125	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.160						
									日付	5/7	5/8	5/9	5/10	5/11
									日銀当預残	3,841,200	3,857,900	3,836,500	3,840,500	3,836,900
									準備預金残	3,374,900	3,403,700	3,375,800	3,384,500	3,380,900
									マネタリーベース	4,937,500	4,951,100	4,926,700	4,929,000	4,923,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.063%	▲0.052%	▲0.042%	▲0.034%
									コール市場残高	106,051	101,918	106,852	102,684	112,760
									うち無担	80,124	77,178	81,372	78,215	86,224
									うちO/N	50,672	47,626	51,520	48,585	56,794
									うち有担	25,927	24,740	25,480	24,469	26,536

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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		
国庫短期証券買入	12,500	2018/5/15			33,982	12,504	0.000		0.002	0.5		
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/5/15			11,408	2,500		0.004	0.005			
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/15			12,430	3,306	0.002		0.003	2.9		
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/15			18,028	4,507	0.002		0.002	39.4		
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,837	2018/5/14	2018/5/15		36	36		▲0.500	▲0.500			
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	4,586	2018/5/14	2018/5/15		3	3		▲0.500	▲0.500			
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)								
被災地金融支援オペ	第85回	2018/5/18	2019/5/17	0	0							
被災地金融支援オペ(熊本)	第24回	2018/5/18	2019/5/17	0	300							

●2018年5月15日の予定

*3月の第3次産業活動指数	*米国3月の企業在庫 *米国4月の小売売上高 *ユーロ圏1-3月期のGDP2次速報	*30年利付国債入札(7,000億円、5/16発行) *交付税特別会計借入(10,500億円、5/24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