

Central Daily Market Report

2018年5月15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15日		2018年5月16日		2018年5月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,300		1,200			0
財政	▲12,900		▲6,700			1,000
資金過不足	▲11,600		▲5,500			1,000
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	12,500					
国債買入	10,400					
CP等買入		▲700		▲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			100			
国債補完供給	▲2,100			2,100		
当預増減	8,500		▲3,500			1,000
当座預金残高	3,838,700		3,835,200			3,836,200
準備預金残高	3,381,700					
積み終了先	3,381,700				5月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,381,600				積数	3,128,500
非準備預金先	457,000				1日平均	100,900
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						3,128,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2018年5月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日要因から、立ち上がりは調整の動きが強く、信託・地銀・証券業態の▲0.040~▲0.030%での出合いが中心となった。しかし、一部の業態では一服感もみられており、一巡後は▲0.060%台で調整の動きが見られた。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(5/15-5/16)は▲0.06~▲0.05%程度、T/N(5/16-5/17)は▲0.13~▲0.065%程度で出合いが見られた。積み期間の変わるT/Nの取引は運用サイドが厚く、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、344、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は新積み期に入り、低下した。アウトライト市場は、3M物が▲0.14~▲0.126%、6M物が▲0.133~▲0.129%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、償還は200億円強と少額であったが、商社・小売業態等からまとまった発行が見られ、発行総額2,200億円強に膨らんだ。発行レートに目立った動きは見られなかった。また、CP等買入オペアが、事前予定通り前回比同額の2,000億円でオファーされ、平均落札レートは前回比横ばいの0.000%、按分落札レートは前回から低下し、▲0.007%の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2018/5/15	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	▲0.036				-	▲0.066	0.050	0.005	22,818.02	▲47.84	109.73-74	109.88-89
T/N	▲0.035	0.001	▲0.010				-	▲0.084						
S/N							-	-						
1W	▲0.045	0.230	▲0.030				-	▲0.094						
2W			▲0.045				-	▲0.099						
3W			0.035				-	▲0.106						
1M							-	▲0.117						
3M			▲0.020				▲0.134	▲0.133						
6M							▲0.130	▲0.148						
1Y							▲0.127	▲0.160						
									日付	5/8	5/9	5/10	5/11	5/14
									日銀当預残	3,857,900	3,836,500	3,840,500	3,836,900	3,830,200
									準備預金残	3,403,700	3,375,800	3,384,500	3,380,900	3,381,300
									マネタリーベース	4,951,100	4,926,700	4,929,000	4,923,700	4,915,600
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.052%	▲0.042%	▲0.034%	▲0.034%
									コール市場残高	101,918	106,852	102,684	112,760	108,649
									うち無担	77,178	81,372	78,215	86,224	82,506
									うちO/N	47,626	51,520	48,585	56,794	53,626
									うち有担	24,740	25,480	24,469	26,536	26,143

●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)
30年利付国債	58	0.80%	7,000	2018/5/16	2048/3/20	24,977.0	5,666.0	101.3000	0.7460%	91.8088%	101.3100	0.7460%	1,325.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/5/24	2018/11/22	206,863.0	10,500.31		0.0000%	5.0760%		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	2018/5/18			5,696	1,981	▲0.007		0.000	53.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	91,448	2018/5/15	2018/5/16		1,926	1,926		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/5/15	2018/5/16		130	130		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/5/17	2018/5/24	2.21						

●2018年5月16日の予定

*1-3月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率▲0.2%)	*米国4月の住宅着工件数 *米国4月の鉱工業生産・設備稼働率	*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値
-------------------------------------	-----------------------------------	--------------------

◆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