

Central Daily Market Report

2018年5月16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16日		2018年5月17日		2018年5月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200	▲100				0
財政	▲7,400	1,400	▲15,000			
資金過不足	▲6,200	1,300	▲15,000			
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			3,300			
CP等買入		▲200	▲100	2,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					300	
社債等買入						
E T F買入	100					
国債補完供給	▲2,000	2,100	2,000			
当預増減	▲6,200	6,500	▲12,700			
当座預金残高	3,832,500	3,839,000	3,826,300			
準備預金残高	3,365,300					
積み終了先	2,063,600	5月17日以降の残り所要積立額				
超過準備	851,900	積数		615,200		
非準備預金先	467,200	1日平均		20,500		
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	80.34%	日数	3.23%		

●2018年5月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀勢を中心に▲0.075～▲0.035%での調達で始まった。積み初日にあたり取り急ぎ動きはなく、一巡後はレートがやや低下し▲0.08%台で散発な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(5/16-5/17)は▲0.10～▲0.085%程度、T/N(5/17-5/18)は▲0.155～▲0.095%程度で出合いが見られた。資金余剰感が強く、前日から更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、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、GCレポレートが低下し全般的に気配が強含みの中、売り物が少なく、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、350億円強の償還に対して、発行も300億円程度にとどまるなど、小口の案件が中心となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/5/16	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	▲0.086	0.001	▲0.055				-	▲0.093	0.050	0.000	22,717.23	▲100.79	110.28-30	110.16-18
T/N			0.000				-	▲0.127						
S/N							-	-						
1W	▲0.050	▲0.040	▲0.046				-	▲0.127						
2W	▲0.040	▲0.025	▲0.035				-	▲0.132						
3W							-	▲0.136						
1M							-	▲0.139						
3M							▲0.135	▲0.143						
6M							▲0.130	▲0.148						
1Y							▲0.128	▲0.160						
									日付	5/9	5/10	5/11	5/14	5/15
									日銀当預残	3,836,500	3,840,500	3,836,900	3,830,200	3,838,700
									準備預金残	3,375,800	3,384,500	3,380,900	3,381,300	3,381,700
									マネタリーベース	4,926,700	4,929,000	4,923,700	4,915,600	4,922,700
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.042%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.036%
									コール市場残高	106,852	102,684	112,760	108,649	108,989
									うち無担	81,372	78,215	86,224	82,506	84,642
									うちO/N	51,520	48,585	56,794	53,626	55,762
									うち有担	25,480	24,469	26,536	26,143	24,347

●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非価格競争入札(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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/5/17			4,572	501	0.008		0.009	92.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/5/17			5,256	1,913	0.007		0.008	7.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/5/17			2,869	712	0.007		0.008	9.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	115,249	2018/5/16	2018/5/17		1,860	1,860		▲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	2018/5/16	2018/5/17		10	10		▲0.500	▲0.500	

●2018年5月17日の予定

*3月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲3.0%)	*国庫短期証券(758回)入札 (1年、21,000億円、5/21発行)	*5年利付国債入札 (20,000億円、5/18発行)
		*国有林野借入 (593億円、5/25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