

# Central Daily Market Report

2018年5月18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18日		2018年5月21日		2018年5月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		700		1,000	
財政	▲ 12,700		▲ 4,000		2,000	
資金過不足	▲ 12,500		▲ 3,300		3,000	
<b>金融調節</b>	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	▲ 1,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,400			
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 400		
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		▲ 100				
E T F 買入	700					
国債補充供給	▲ 500	1,900		500		
当預増減	▲ 8,400		7,300		3,000	
当座預金残高	3,827,600		3,834,900		3,837,900	
準備預金残高	3,353,500					
積み終了先	3,337,200		5月21日以降の残り所要積立額		積数 26,500	
超過準備	3,314,700		1日平均		1,000	
非準備預金先	474,100					
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	99.15%	日数	16.13%		

## ●2018年5月18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・証券業態を中心に▲0.085~▲0.04%での調達で始まった。週末ではあったものの調達ニーズは引き続き弱く、一巡後は▲0.086~▲0.05%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、ショートタームを中心に数件の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(5/18-5/21)は▲0.10~▲0.09%、T/N(5/21-5/22)は▲0.135~▲0.10%程度で出合いが見られた。T/Nの取引は短国の発行が2本重なり、小幅にレートが上昇した。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。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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.145~▲0.144%での強めの出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1391%、按分落札利回▲0.1323%としっかりした結果となった。セカンダリーでは▲0.144~▲0.135%の出合いと底堅く推移した。この他に、1Y物が▲0.143~▲0.142%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、600億円強の償還に対して、1,000億円強の発行が見られ、商社・石油業態からは大型発行案件も実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移し、0%付近での決着が中心となっている。

## ●短期金融市場関連指標

2018/5/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	
	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	▲ 0.064				-	▲ 0.102	0.055	0.000	22,930.36	91.99	110.85-86	110.89-90
T/N			0.000				-	▲ 0.129						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.140						
2W							-	▲ 0.142						
3W			0.035				-	▲ 0.144						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.149						
3M							▲ 0.135	▲ 0.148						
6M							▲ 0.130	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.143	▲ 0.160						
									日付	5/11	5/14	5/15	5/16	5/17
									日銀当預残	3,836,900	3,830,200	3,838,700	3,832,500	3,836,000
									準備預金残	3,380,900	3,381,300	3,381,700	3,365,300	3,369,500
									マネタリーベース	4,923,700	4,915,600	4,922,700	4,915,400	4,918,900
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.034%	▲0.036%	▲0.055%	▲0.062%
									コール市場残高	112,760	108,649	108,989	91,820	93,791
									うち無担	86,224	82,506	84,642	70,357	70,745
									うちO/N	56,794	53,626	55,762	43,757	43,895
									うち有担	26,536	26,143	24,347	21,463	23,046

## ●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	759	-	43,800	2018/5/21	2018/8/20	178,883.0	35,716.40	100.0330	▲0.1323%	76.2891%	100.0347	▲0.1391%	8,083.0

## ●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	2018/5/21	2018/6/4		1,983	1,983				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/5/21			9,431	2,508	0.006		0.007	54.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/21			9,745	3,307	0.006		0.007	12.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/21			13,674	4,507	0.005		0.006	66.1
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	51,730	2018/5/18	2018/5/21		512	512		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年5月21日の予定

\*4月の貿易統計

◆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