

Central Daily Market Report

2018年5月21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21日 需給速報	2018年5月22日 需給予想	2018年5月23日 当社予想
銀行券	600	500	▲1,000
財政	▲6,200	2,900	▲12,000
資金過不足	▲5,600	3,400	▲13,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
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		10,000	
国債買入	10,400		
CP等買入		▲400	▲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			▲100
ETF買入		300	
国債補充供給	▲700	500	700
当預増減	4,300	14,000	▲13,000
当座預金残高	3,831,900	3,845,900	3,832,900
準備預金残高	3,354,500		
積み終了先	3,351,600		
超過準備	3,346,900		
非準備預金先	477,400		
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	99.39%	日数
			19.35%

●2018年5月21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▲0.086~▲0.045%での調達で始まった。先週からの流れを受け、引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は閑散とした状況のなか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会いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T+0(5/21-5/22)は▲0.105~▲0.095%、T/N(5/22-5/23)は▲0.120~▲0.100%程度で出会いが見られた。T/Nは日銀オペの影響で業者の売物は減少している。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見立った。

＜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10,000億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.003%と小じっかりの結果となった。マーケットでは3M物が▲0.14~▲0.135%、1Y物が▲0.145~▲0.143%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、非鉄金属業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は700億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/5/21	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	▲0.086	0.001	▲0.068				-	▲0.101	0.051	▲0.004	23,002.37	72.01	110.89-90	111.35-37
T/N			0.000				-	▲0.117						
S/N							-	-						
1W	▲0.055	▲0.020	▲0.044				-	▲0.131						
2W	▲0.038	▲0.032	▲0.034				-	▲0.134						
3W							-	▲0.138						
1M							-	▲0.142						
3M							▲0.137	▲0.146						
6M							▲0.133	▲0.149						
1Y							▲0.144	▲0.160						
									日付	5/14	5/15	5/16	5/17	5/18
									日銀当預残	3,830,200	3,838,700	3,832,500	3,836,000	3,827,600
									準備預金残	3,381,300	3,381,700	3,365,300	3,369,500	3,353,200
									マネタリーベース	4,915,600	4,922,700	4,915,400	4,918,900	4,910,300
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.036%	▲0.055%	▲0.062%	▲0.064%
									コール市場残高	108,649	108,989	91,820	93,791	96,509
									うち無担	82,506	84,642	70,357	70,745	73,801
									うちO/N	53,626	55,762	43,757	43,895	47,151
									うち有担	26,143	24,347	21,463	23,046	22,708

●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
国庫短期証買入	10,000	2018/5/22			27,280	10,004	▲0.003		▲0.001	82.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	171,755	2018/5/21	2018/5/22		664	664		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,852	2018/5/21	2018/5/22		74	74		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月22日の予定

*20年利付国債入札 (10,000億円、5/23発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、5/30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たい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