

Central Daily Market Report

2018年5月22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22日 需給速報	2018年5月23日 需給予想	2018年5月24日 当社予想
銀行券	400	▲ 300	▲ 1,000
財政	▲ 400	▲ 13,200	▲ 2,000
資金過不足	0	▲ 13,500	▲ 3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	10,000		
国債買入			
CP等買入		▲ 300	▲ 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		▲ 100	
E T F 買入	300		
国債補完供給	▲ 400	700	400
当預増減	10,200	▲ 13,300	▲ 3,000
当座預金残高	3,842,100	3,828,800	3,825,800
準備預金残高	3,366,400		
積み終了先	3,363,900		
超過準備	3,363,300		
非準備預金先	475,700		
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	99.49%	日数
			22.58%

●2018年5月22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。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は目立った出合いが見られず本日の取引を終えた。ターム物も、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(5/22-5/23)は▲0.100%近辺の気配、T/N(5/23-5/24)は▲0.120~▲0.100%程度で出合いが見られた。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物が▲0.141~▲0.14%、6M物が▲0.146%、1Y物が▲0.146~▲0.145%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社、鉄鋼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600億円程度と閑散。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

2018/5/22	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.068				-	▲ 0.101	0.045	▲ 0.006	22,960.34	▲ 42.03	110.99-00	111.07-09
T/N			0.000				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.046				-	▲ 0.126						
2W	▲ 0.050	▲ 0.010	▲ 0.042				-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.134						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.138						
3M							▲ 0.139	▲ 0.143						
6M							▲ 0.135	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.160						
									日付	5/15	5/16	5/17	5/18	5/21
									日銀当預残	3,838,700	3,832,500	3,836,000	3,827,600	3,831,900
									準備預金残	3,381,700	3,365,300	3,369,500	3,353,200	3,354,500
									マネタリーベース	4,922,700	4,915,400	4,918,900	4,910,300	4,914,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.036%	▲ 0.055%	▲ 0.062%	▲ 0.064%	▲ 0.068%
									コール市場残高	108,989	91,820	93,791	96,509	91,926
									うち無担	84,642	70,357	70,745	73,801	69,554
									うちO/N	55,762	43,757	43,895	47,151	42,744
									うち有担	24,347	21,463	23,046	22,708	22,372

●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)
20年利付国債	164	0.50%	10,000	2018/5/23	2038/3/20	32,951.0	7,998.0	99.4000	0.5330%	87.1182%	99.4200	0.5320%	1,991.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/5/30	2018/11/30	209,952.0	10,500.43		0.0000%	5.0300%		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
社債等買入	1,000	2018/5/28			1,711	1,000	▲0.224		▲0.186	43.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,790	2018/5/22	2018/5/23		140	140		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,982	2018/5/22	2018/5/23		248	248		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/5/24	2018/6/1	2.21	1	1				

●2018年5月23日の予定

*月例経済報告

*米国4月の新築一戸建て販売件数

*英国4月の消費者物価指数

◆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