

Central Daily Market Report

2018年5月23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23日 需給速報	2018年5月24日 需給予想	2018年5月25日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,300	▲ 1,000
財政	▲ 14,200	800	▲ 7,000
資金過不足	▲ 14,500	▲ 500	▲ 8,000
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			
国債買入		8,600	
CP等買入	▲ 200	▲ 400	
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			
国債補充供給	▲ 300	400	300
当預増減	▲ 14,600	8,000	▲ 8,000
当座預金残高	3,827,500	3,835,500	3,827,500
準備預金残高	3,352,500		
積み終了先	3,350,200		
超過準備	3,350,200		
非準備預金先	475,000		
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	99.57%	日数
			25.81%

●2018年5月23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~▲0.05%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(5/23-5/24)は▲0.105~▲0.100%の出合い、T/N(5/24-5/25)は▲0.120~▲0.100%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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.147~▲0.144%、1Y物が▲0.147~▲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25日発行となり、鉄鋼、陸運、ノンバンク業態からとまった発行が見られ総額2,250億円程度に膨らんだ。発行レートは一部銘柄で強めの出合いが見られたが、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/5/23	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	▲ 0.070				-	▲ 0.103	0.040	▲ 0.005	22,689.74	▲ 270.60	110.73-74	109.99-01
T/N			0.000				-	▲ 0.116						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.050				-	▲ 0.128						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.131						
3W							-	▲ 0.134						
1M							-	▲ 0.138						
3M							▲ 0.144	▲ 0.144						
6M							▲ 0.135	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.146	▲ 0.160						
									日付	5/16	5/17	5/18	5/21	5/22
									日銀当預残	3,832,500	3,836,000	3,827,600	3,831,900	3,842,100
									準備預金残	3,365,300	3,369,500	3,353,200	3,354,500	3,366,400
									マネタリーベース	4,915,400	4,918,900	4,910,300	4,914,000	4,923,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.062%	▲ 0.064%	▲ 0.068%	▲ 0.068%
									コール市場残高	91,820	93,791	96,509	91,926	87,980
									うち無担	70,357	70,745	73,801	69,554	67,392
									うちO/N	43,757	43,895	47,151	42,744	41,432
									うち有担	21,463	23,046	22,708	22,372	20,588

●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	応募総額(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年超3年以下)	2,500	2018/5/24			10,311	2,502	0.003		0.004	35.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/24			10,340	3,305	0.000		0.001	15.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/5/24			3,818	1,911	0.000		0.001	96.0
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/5/24			2,179	709	0.002		0.003	10.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,772	2018/5/23	2018/5/24		239	239		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/5/23	2018/5/24		75	75		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年5月24日の予定

*櫻井審議委員、群馬県金融経済懇談会にて講演	*米国4月の中古住宅販売	*流動性供給入札(6,000億円、5/25発行)
------------------------	--------------	--------------------------

◆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