

# Central Daily Market Report

2018年5月24日(木)  
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24日		2018年5月25日		2018年5月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 500			1,000
財政	▲ 1,800		▲ 6,300			5,000
資金過不足	▲ 3,200		▲ 6,800			6,000
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						▲ 2,000
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		▲ 400		▲ 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				▲ 200		1,000
ETF買入				400		
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減		5,000		▲ 6,500		5,000
当座預金残高		3,832,500		3,826,000		3,831,000
準備預金残高		3,359,600				
積み終了先		3,356,800				
超過準備		3,356,800			5月25日以降の残り所要積立額	積数 10,700
非準備預金先		472,900			1日平均	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	99.66%	日数		29.03%

## ●2018年5月24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合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(5/24-5/25)は▲0.105~▲0.100%の出合い、T/N(5/25-5/28)は▲0.155~▲0.12%近辺での出合いが中心となった。週末を挟むところで、投資家の資金調達意欲がやや消極的となっている。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目立った。

### <短国市場>

現先レートT/Nは品薄感が強く低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.147%、1Y物が▲0.146%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は電機業態から500億円のまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は850億円程度と閑散。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

2018/5/24	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				-	▲ 0.102	0.040	0.000	22,437.01	▲ 252.73	109.88-90	109.61-63
T/N			0.000				-	▲ 0.126						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.058	0.050	▲ 0.025				-	▲ 0.133						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.136						
3W			▲ 0.050				-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.144	▲ 0.147						
6M							▲ 0.135	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.146	▲ 0.161						
									日付	5/17	5/18	5/21	5/22	5/23
									日銀当預残	3,836,000	3,827,600	3,831,900	3,842,100	3,827,500
									準備預金残	3,369,500	3,353,200	3,354,500	3,366,400	3,352,500
									マネタリーベース	4,918,900	4,910,300	4,914,000	4,923,800	4,909,500
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.064%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.070%
									コール市場残高	93,791	96,509	91,926	87,980	87,226
									うち無担	70,745	73,801	69,554	67,392	66,862
									うちO/N	43,895	47,151	42,744	41,432	40,842
									うち有担	23,046	22,708	22,372	20,588	20,364

## ●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)
流動性供給	262	-	6,000	2018/5/25		20,067.0	5,971.00		▲0.0070%	85.8474%		▲0.0080%	

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,000	2018/5/24	2018/5/25		326	326		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年5月25日の予定

*5月の東京都都区消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%	*米国4月の耐久財新規受注 *英国1-3月期のGDP改定値	*国庫短期証券(760回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/28発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、6/4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