

Central Daily Market Report

2018年5月25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25日		2018年5月28日		2018年5月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		200			0
財政	▲ 4,600		▲ 400			1,000
資金過不足	▲ 5,200		▲ 200			1,000
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			1,600	▲ 2,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 500		
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			
E T F 買入	400					
国債補充供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 5,200		10,900			1,000
当座預金残高	3,827,300		3,838,200			3,839,200
準備預金残高	3,348,700					
積み終了先	3,347,700				5月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,346,900				積数	5,200
非準備預金先	478,600				1日平均	300
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	99.83%	日数	38.71%		

●2018年5月25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~▲0.05%での調達で始まった。週末であったものの、調達ニーズの弱い地合いに変化は無く、一巡後は散発的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(5/25-5/28)は▲0.10%近辺の気配、T/N(5/28-5/29)は▲0.155~▲0.12%近辺での出合いが中心となった。T/NはTDB3M物発行の影響で、業者の売物がやや増加している。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、350、5Y135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▲0.15~▲0.145%での強めの出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1431%、按分落札利回▲0.1383%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲0.145~▲0.144%出合いと堅調に推移した。この他に、1Y物が▲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、不動産、ノンバンク業態からまとまった発行が見られ、総額2,600億円程度に膨らんだ。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

2018/5/25	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.128	0.035	▲ 0.005	22,450.79	13.78	109.31-33	109.36-38
T/N			0.000				-	▲ 0.150						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.150						
2W	▲ 0.030	0.020	▲ 0.009				-	▲ 0.149						
3W							-	▲ 0.150						
1M	▲ 0.050	0.040	▲ 0.029				-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.144	▲ 0.153						
6M							▲ 0.134	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.162						
									日付	5/18	5/21	5/22	5/23	5/24
									日銀当預残	3,827,600	3,831,900	3,842,100	3,827,500	3,832,500
									準備預金残	3,353,200	3,354,500	3,366,400	3,352,500	3,359,600
									マネタリーベース	4,910,300	4,914,000	4,923,800	4,909,500	4,915,900
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.070%
									コール市場残高	96,509	91,926	87,980	87,226	88,300
									うち無担	73,801	69,554	67,392	66,862	66,199
									うちO/N	47,151	42,744	41,432	40,842	40,059
									うち有担	22,708	22,372	20,588	20,364	22,101

●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	760	-	43,500	2018/5/28	2018/8/27	159,855.0	35,326.4	100.0345	▲0.1383%	86.9463%	100.0357	▲0.1431%	8,173.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/6/4	2018/12/4	213,601.0	10,500.15		0.0000%	4.9159%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/5/28	2018/6/11		1,571	1,571				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/5/28			11,206	2,505	0.005		0.005	72.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/28			11,162	3,302	0.002		0.002	69.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/28			15,045	4,506	0.002		0.003	37.1
国債買入(物価連動債)	250	2018/5/28			1,558	253	▲0.160		▲0.182	26.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	128,942	2018/5/25	2018/5/28		227	227		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	34,683	2018/5/25	2018/5/28		51	51		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月28日の予定

*4月の企業向けサービス価格指数

*New York祝日(Memorial Day)

*London祝日(Spring Bank Holiday)

◆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