

Central Daily Market Report

2018年5月28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28日 需給速報	2018年5月29日 需給予想	2018年5月30日 当社予想			
銀行券	0	▲ 200	▲ 1,000			
財政	200	2,900	▲ 4,000			
資金過不足	200	2,700	▲ 5,000			
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			5,000			
国債買入	10,700					
CP等買入		▲ 500	▲ 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	1,000					
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	300	100			
当預増減	11,200	7,500	▲ 5,000			
当座預金残高	3,838,500	3,846,000	3,841,000			
準備預金残高	3,357,000					
積み終了先	3,356,400			5月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,356,400			積数	4,600	
非準備預金先	481,500			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	99.85%	日数	41.94%		

●2018年5月28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。先週末に比べ、ビッド数がやや減少した事で、一巡後は目立った出合いも見られず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(5/28-5/29)は、▲0.100%近辺の出合い。T/N(5/29-5/30)は、▲0.150~▲0.140%近辺での出合い。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。10Y336~350、5Y130~135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、短国買入オペアが5,000億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。応募額は2兆円弱と多かったものの、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%と小じつかりの結果となった。マーケットでは3M物が▲0.146~▲0.144%で出会った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額1,700億円程度に対して、発行総額は5,500億円程度と大きく発行超であった。月末発行の前倒し案件が膨らみ活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オペアが2,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート0.002%・按分レート▲0.004%と、前回(平均0.000%・按分▲0.007%)比で両レートとも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/5/28	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	▲ 0.069				-	▲ 0.110	0.035	0.000	22,481.09	30.30	109.61-62	109.45-46
T/N			0.000				-	▲ 0.152						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.045	▲ 0.049				-	▲ 0.155						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.154						
3W							-	▲ 0.154						
1M							-	▲ 0.158						
3M							▲ 0.144	▲ 0.155						
6M							▲ 0.133	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.162						
									日付	5/21	5/22	5/23	5/24	5/25
									日銀当預残	3,831,900	3,842,100	3,827,500	3,832,500	3,827,300
									準備預金残	3,354,500	3,366,400	3,352,500	3,359,600	3,348,700
									マネタリーベース	4,914,000	4,923,800	4,909,500	4,915,900	4,911,200
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.071%
									コール市場残高	91,926	87,980	87,226	88,300	86,160
									うち無担	69,554	67,392	66,862	66,199	68,024
									うちO/N	42,744	41,432	40,842	40,059	41,774
									うち有担	22,372	20,588	20,364	22,101	18,136

●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
国庫短期証券買入	5,000	2018/5/29			18,578	5,003	▲0.002		▲0.001	83.7
CP等買入	2,000	2018/5/31			5,320	1,992	▲0.004		0.002	54.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	58,500	2018/5/28	2018/5/29		115	115		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	14,190	2018/5/28	2018/5/29		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月29日の予定

*4月の完全失業率(市場予想：2.5%)	*米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(4,000億円、5/30発行)
*4月の有効求人倍率(市場予想：1.6倍)	*米国5月のCB消費者信頼感指数	

◆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