

# Central Daily Market Report

2018年5月29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29日		2018年5月30日		2018年5月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		100		600	
財政	▲ 1,100		▲ 8,100		4,000	
資金過不足	▲ 1,400		▲ 8,000		4,600	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200	2,000	
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						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	3,300		▲ 8,200		6,600	
当座預金残高	3,841,800		3,833,600		3,840,200	
準備預金残高	3,360,400					
積み終了先	3,359,900				5月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,359,900				積数	
非準備預金先	481,400				1日平均	
					200	
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	99.87%	日数	45.16%		

## ●2018年5月29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。引き続き調達ニーズの弱い状況に変化は無く、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(5/29-5/30)は、▲0.100%近辺の出合い。T/N(5/30-5/31)は、▲0.175~▲0.150%程度での出合い。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は小幅に低下した。アウトライト市場は、3M物が▲0.15~▲0.147%で出合った。

### <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7,500億円程度に対して、発行総額は1兆2,000億円程度と大きく発行超であった。発行日が月末となったことで、幅広い業態において大型発行案件が数多く見られた。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

2018/5/29	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	▲ 0.070				-	▲ 0.115	0.030	▲ 0.005	22,358.43	▲ 122.66	109.39-41	108.74-75
T/N			0.000				-	▲ 0.156						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.030	▲ 0.011				-	▲ 0.160						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.160						
3W							-	▲ 0.160						
1M			0.001				-	▲ 0.162						
3M							▲ 0.150	▲ 0.156						
6M							▲ 0.133	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.163						
									日付	5/22	5/23	5/24	5/25	5/28
									日銀当預残	3,842,100	3,827,500	3,832,500	3,827,300	3,838,500
									準備預金残	3,366,400	3,352,500	3,359,600	3,348,700	3,357,000
									マネタリーベース	4,923,800	4,909,500	4,915,900	4,911,200	4,922,400
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.069%
									コール市場残高	87,980	87,226	88,300	86,160	83,040
									うち無担	67,392	66,862	66,199	68,024	58,424
									うちO/N	41,432	40,842	40,059	41,774	32,504
									うち有担	20,588	20,364	22,101	18,136	24,616

## ●入札結果

名称	回数	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)
40年利付国債	11	0.80%	4,000	2018/5/30	2058/3/20	15,670.0	3,994.00	97.8100	0.8650%	52.4978%			

## ●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)	40,000	2018/5/29	2018/5/30		104	104		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	24,087	2018/5/29	2018/5/30		15	15		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年5月30日の予定

\*黒田日銀総裁、日本銀行金融研究所主催2018年国際コンファランスにて講演  
\*4月の商業動態統計速報  
\*5月の消費動向調査

\*米国ページブック  
\*米国1-3月期のGDP改定値

◆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