

Central Daily Market Report

2018年5月30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30日 需給速報	2018年5月31日 需給予想	2018年6月1日 当社予想
銀行券	100	▲ 500	0
財政	▲ 5,400	200	▲ 28,000
資金過不足	▲ 5,300	▲ 300	▲ 28,000
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		7,500	
CP等買入	▲ 200	2,000	▲ 1,100
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		▲ 100
E T F買入		300	
国債補完供給	▲ 200	100	200
当預増減	▲ 5,700	8,500	▲ 28,000
当座預金残高	3,836,100	3,844,600	3,816,600
準備預金残高	3,351,800		
積み終了先	3,351,000		
超過準備	3,351,000		
非準備預金先	484,300		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額			3,128,800
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数
			48.39%

●2018年5月30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は弱く、一巡後は目立った出合いは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(5/30-5/31)は、▲0.100%近辺の出合い。T/N(5/31-6/1)は、▲0.250~▲0.140%程度での出合い。T/Nは月末要因からレートを切り下げたが、引けにかけては前日並みまでレートを戻した。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。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は末初に該当し、大幅に低下した。アウトライト市場は、レポレートの低下を受けて、3M物が▲0.16~▲0.155%と強含みの出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は3,000億円程度と発行超であった。石油・卸売業態において大型案件が見られ、月初発行があったことで案件数も膨らみ、比較的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。

●短期金融市場関連指標

2018/5/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070					-	▲ 0.117	0.025	▲ 0.005	22,018.52	▲ 339.91	108.40-42	108.72-73
T/N			0.000					-	▲ 0.240						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.053	▲ 0.043	▲ 0.046					-	▲ 0.177						
2W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.037					-	▲ 0.171						
3W								-	▲ 0.166						
1M								-	▲ 0.167						
3M								▲ 0.155	▲ 0.157						
6M								▲ 0.132	▲ 0.152						
1Y								▲ 0.144	▲ 0.163						
										日付	5/23	5/24	5/25	5/28	5/29
										日銀当預残	3,827,500	3,832,500	3,827,300	3,838,500	3,841,800
										準備預金残	3,352,500	3,359,600	3,348,700	3,357,000	3,360,400
										マネタリーベース	4,909,500	4,915,900	4,911,200	4,922,400	4,925,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.070%	▲ 0.070%	▲ 0.071%	▲ 0.069%	▲ 0.070%
										コール市場残高	87,226	88,300	86,160	83,040	77,024
										うち無担	66,862	66,199	68,024	58,424	61,135
										うちO/N	40,842	40,059	41,774	32,504	34,645
										うち有担	20,364	22,101	18,136	24,616	15,889

●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)	発札総額(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	平均発札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/5/31			15,183	4,508	▲0.008		▲0.007	51.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/5/31			3,548	1,906	▲0.009		▲0.008	98.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/5/31			2,618	713	▲0.018		▲0.018	62.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,762	2018/5/30	2018/5/31		158	158		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/6/1	2018/6/7	2.2	0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化 本則第32回	2018/6/4	2022/6/3	0	5,222	39					
成長基盤強化 ABL等特則第28期	2018/6/5	2022/6/3	0	13	4					
成長基盤強化 小口特則第25期	2018/6/4	2022/6/3	0	7.38	8					
成長基盤強化 米ドル特則第24期	2018/6/4	2019/6/4		1,450	22					
成長基盤強化 米ドル特則第20期(借り換え)	2018/6/4	2019/6/4		3,965	34					
成長基盤強化 米ドル特則第16期(借り換え)	2018/6/4	2019/6/4		115	15					
成長基盤強化 米ドル特則第12期(借り換え)	2018/6/4	2019/6/4		39	12					

●2018年5月31日の予定

*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+1.2%)	*米国4月の個人所得・消費支出	*米国5月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札
*4月の住宅着工統計	*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値		(21,000億円、6/1発行)

◆本資料は信頼できるとさ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