

# Central Daily Market Report

2018年5月31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31日		2018年6月1日		2018年6月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		2,000	
財政	▲ 1,000		▲ 33,700		▲ 47,000	
資金過不足	▲ 1,400		▲ 34,100		▲ 45,000	
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	7,500					
CP等買入	2,000	▲ 1,100				
貸出支援基金(成)					5,200	▲ 4,200
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
ETF買入	300					
国債補完供給	▲ 1,100	200		1,100		
当預増減	6,300		▲ 33,100		▲ 46,000	
当座預金残高	3,842,400		3,809,300		3,763,300	
準備預金残高	3,351,900					
積み終了先	3,351,600				6月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,351,500				積数 3,000	
非準備預金先	490,500				1日平均 200	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,124,900	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	51.61%		

## ●2018年5月31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。月末で調達を控える先も多く、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会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(5/31-6/1)は、▲0.100%近辺の出会い。T/N(6/1-6/4)は、▲0.155~▲0.130%程度での出会い。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入札を控え、様子見閑散なか、3M物が▲0.157%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。発行市場は償還総額700億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超であった。卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着いた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

2018/5/31	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.111	0.030	0.005	22,201.82	183.30	108.73-74	108.76-77
T/N			0.000				-	▲ 0.145						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.058	0.030	▲ 0.026				-	▲ 0.151						
2W			0.000				-	▲ 0.152						
3W							-	▲ 0.152						
1M			0.030				-	▲ 0.163						
3M							▲ 0.155	▲ 0.157						
6M							▲ 0.132	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.143	▲ 0.163						
									日付	5/24	5/25	5/28	5/29	5/30
									日銀当預残	3,832,500	3,827,300	3,838,500	3,841,800	3,836,100
									準備預金残	3,359,600	3,348,700	3,357,000	3,360,400	3,351,800
									マネタリーベース	4,915,900	4,911,200	4,922,400	4,925,900	4,920,100
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.071%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.070%
									コール市場残高	88,300	86,160	83,040	77,024	78,816
									うち無担	66,199	68,024	58,424	61,135	62,356
									うちO/N	40,059	41,774	32,504	34,645	34,936
									うち有担	22,101	18,136	24,616	15,889	16,460

## ●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)
2年利付国債	389	0.10%	21,000	2018/6/1	2020/6/1	84,255.0	17,164.00	100.4900	▲0.1440%	13.7252%	100.4960	▲0.1470%	3,830.0

## ●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)	125,503	2018/5/31	2018/6/1		950	950		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	18,442	2018/5/31	2018/6/1		106	106		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年6月1日の予定

\*1-3月期の法人企業統計調査季報

\*米国4月の建設支出  
\*米国5月の雇用統計  
\*米国5月のISM製造業景況指数

\*国庫短期証券(761回)入札  
(3ヶ月、44,000億円、6/4発行)

◆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