Central Daily Market Report

2018年3月30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3月30日 需給速報		2018年4月2日 需給予想		2018年4月3日 当社予想	
銀行券	100		900		1,000	
財政	18,500		▲ 6,100		▲ 12,000	
資金過不足	18,600		▲ 5,200		▲ 11,000	
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			1,400	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	3,400				10,300	
CP等買入	5,000	▲ 7,100		▲ 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						
ＥＴＦ買入	1,300		300			
国債補完供給	▲ 3,100	400		3,100		
当預増減	18,500		▲ 2,000		▲ 700	

当座預金残高	3,782,900	3,780,900	3,780,200
準備預金残高	3,343,200		
積み終了先	3,343,000		
超過準備	3,340,300		
非準備預金先	439,700		

4月2日以降の残り所要積立額	
積数	2,000
1日平均	100

積み期間（3/16～4/15）の所要準備額			3,053,200
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数 54.84%

●2018年3月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は地銀、証券、信託業態の調達で▲0.086～▲0.050%での出合いが中心となった。決算期末の取引となったことで取り手が薄く、軟調な地合いとなった。一巡後はオファー残りの状態が続く中、▲0.086～▲0.080%程度で散発的な出合いが見られていた。ターム物に関しては4月スタートのショートターム物で▲0.035%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(4/2-4/3)は▲0.130～▲0.120%程度、S/N(4/3-4/4)は▲0.135～▲0.120%程度で出合いが見られた。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。個別銘柄では5Y130～135、10Y336～350、30Y58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、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、償還が非常に少なかったものの、商社・鉄鋼等で大ロットの発行案件が複数実施されたため、3,200億円弱の発行となった。発行レートは、前日と比較し、全体的に若干上昇した印象であった。

●短期金融市場関連指標

2018/3/30	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				－	▲ 0.184
T/N			0.000				－	▲ 0.123
S/N							－	－
1W			▲ 0.025				－	▲ 0.126
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.032				－	▲ 0.127
3W			0.000				－	▲ 0.130
1M	▲ 0.023	0.010	▲ 0.017				－	▲ 0.141
3M							▲ 0.156	▲ 0.146
6M							▲ 0.147	▲ 0.155
1Y							▲ 0.150	▲ 0.165

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.041	0.006	21,454.30	295.22	106.47-50	106.18-19

日付	3/23	3/26	3/27	3/28	3/29
日銀当預残	3,708,900	3,740,100	3,752,800	3,751,900	3,764,400
準備預金残	3,244,400	3,280,800	3,294,200	3,294,400	3,308,700
マネタリーベース	4,795,800	4,826,800	4,839,800	4,838,900	4,852,100
無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.066%	▲0.066%	▲0.066%
コール市場残高	117,098	112,947	111,565	108,498	111,151
うち無担	95,257	90,652	92,336	88,762	94,579
うちO/N	66,337	61,052	63,606	61,012	67,539
うち有担	21,841	22,295	19,229	19,736	16,572

●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Ｉ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	2,500	2018/4/3			10,009	2,511	0.003		0.004	25.4
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,300	2018/4/3			11,585	3,303	0.003		0.003	80.2
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,500	2018/4/3			16,440	4,508	0.003		0.004	12.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	100,742	2018/3/30	2018/4/2		3,006	3,006		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月2日の予定

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：＋25
*米国2月の建設支出
*米国3月のISM製造業景況指数
*EURO、London祝日(Easter Monday)

◆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。
◆本資料は何ら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論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