

# Central Daily Market Report

2018年4月2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4月2日		2018年4月3日		2018年4月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		1,000		1,000	
財政	▲ 2,100		▲ 16,300		15,000	
資金過不足	▲ 1,100		▲ 15,300		16,000	
<b>金融調節</b>	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			10,400		2,900	
CP等買入		▲ 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						
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 300	3,100		300		
当預増減	1,800		▲ 4,700		18,900	
当座預金残高	3,784,700		3,780,000		3,798,900	
準備預金残高	3,328,000					
積み終了先	3,327,600		4月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,327,600		積数		1,700	
非準備預金先	456,700		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		99.94%		日数	
					58.06%	

## ●2018年4月2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▲0.085~▲0.05%での出会いが中心となった。新年度に入ったものの先週末までの流れを引き継ぎ、一巡後は調整から▲0.085~▲0.060%程度のお合いが散見された程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.05~▲0.025%程度のお合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(4/3-4/4)は▲0.150~▲0.130%程度、S/N(4/4-4/5)は▲0.155~▲0.140%程度で出会いが見られた。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、今週実施される3本の入札を控えて閑散としており、特段のお合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社、鉄鋼、陸運業態からまとまった発行が見られ、総額1,300億円程度に達した。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

2018/4/2	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	▲ 0.067				-	▲ 0.124	0.040	▲ 0.001	21,388.58	▲ 65.72	106.31-33	106.28-29
T/N			0.000				-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.038				-	▲ 0.135						
3W							-	▲ 0.136						
1M	0.000	0.030	0.015				-	▲ 0.142						
3M	0.001	0.200	0.007				▲ 0.151	▲ 0.144						
6M							▲ 0.143	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.163						
									日付	3/26	3/27	3/28	3/29	3/30
									日銀当預残	3,740,100	3,752,800	3,751,900	3,764,400	3,782,900
									準備預金残	3,280,800	3,294,200	3,294,400	3,308,700	3,343,200
									マネタリーベース	4,826,800	4,839,800	4,838,900	4,852,100	4,870,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.068%
									コール市場残高	112,947	111,565	108,498	111,151	53,258
									うち無担	90,652	92,336	88,762	94,579	43,761
									うちO/N	61,052	63,606	61,012	67,539	33,311
									うち有担	22,295	19,229	19,736	16,572	9,497

## ●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
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/4/4			6,190	1,910	0.011		0.012	26.6
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/4/4			2,374	704	0.012		0.012	73.5
国債買入(物価連動債)	250	2018/4/4			1,476	251	▲ 0.060		▲ 0.115	53.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,020	2018/4/2	2018/4/3		144	144		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/4/2	2018/4/3		90	90		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2018年4月3日の予定

*3月のマネタリーベース *3月実績/4月見込み財政資金対民間収支	*国庫短期証券(748回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/5発行)	*10利付国債入札 (22,000億円、4/5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