

Central Daily Market Report

2018年4月3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4月3日 需給速報	2018年4月4日 需給予想	2018年4月5日 当社予想
銀行券	1,100	500	0
財政	▲ 15,100	4,000	▲ 34,000
資金過不足	▲ 14,000	4,500	▲ 34,000
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	10,400	3,000	
CP等買入		▲ 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		400	
国債補完供給	▲ 200	300	200
当預増減	▲ 3,600	8,100	▲ 34,000
当座預金残高	3,781,100	3,789,200	3,755,200
準備預金残高	3,331,600		
積み終了先	3,331,400		
超過準備	3,331,400		
非準備預金先	449,500		
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	99.95%	日数
			61.29%

●2018年4月3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~▲0.045%での出合いが中心となった。一巡後は▲0.08~▲0.075%程度の調整の出合いが散見された程度で、本日の取引を終えた。ターム物の出合いはショートターム物でロール案件中心の取引であった。

<レポ市場>

GC T/N(4/4-5)は▲0.140~▲0.100%程度、S/N(4/5-4/6)は▲0.110~▲0.100%程度で出合いが見られた。S/Nは期初の短国の入札・発行の影響からオファーサイドのファンディングニーズが厚くなっており、レート水準を一段上げての出合いとなった。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、10Y336~349、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.15~▲0.14%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1393%、按分落札利回▲0.1326%と前回債から上昇する結果となった。年度末の担保需要の剥落や、今週中の短国入札が3回と多いことで需給悪化懸念が持たれていること、等の要因から慎重姿勢が強まった。セカンダリーでは、▲0.137~▲0.131%の出合いと足切り近辺での推移となった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場はノンバンクを中心に発行が見られたものの、全体の発行額は400億円程度と閑散。発行レートは引続き横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/4/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.115	0.020	▲ 0.020	21,292.29	▲ 96.29	105.79-81	106.04-05
T/N			0.000				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.035	▲ 0.041				-	▲ 0.118						
2W							-	▲ 0.121						
3W	▲ 0.010	0.035	0.020				-	▲ 0.125						
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.136						
3M	0.001	0.180	0.017				▲ 0.132	▲ 0.142						
6M							▲ 0.138	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.162						
									日付	3/27	3/28	3/29	3/30	4/2
									日銀当預残	3,752,800	3,751,900	3,764,400	3,782,900	3,784,700
									準備預金残	3,294,200	3,294,400	3,308,700	3,343,200	3,328,000
									マネタリーベース	4,839,800	4,838,900	4,852,100	4,870,500	4,871,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.068%	▲ 0.067%
									コール市場残高	111,565	108,498	111,151	53,258	93,841
									うち無担	92,336	88,762	94,579	43,761	80,267
									うちO/N	63,606	61,012	67,539	33,311	60,217
									うち有担	19,229	19,736	16,572	9,497	13,574

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	748	-	43,500	2018/4/5	2018/7/2	176,898.0	35,455.40	100.0320	▲0.1326%	8.3856%	100.0336	▲0.1393%	8,044.0
10年利付国債	350	0.10%	22,000	2018/4/5	2028/3/20	74,458.0	17,897.00	100.6600	0.0330%	4.0302%	100.6700	0.0320%	4,082.0

●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	入札総額(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)	51,775	2018/4/3	2018/4/4		196	196		▲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	2018/4/3	2018/4/4		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/4/5	2018/4/12	2.18	0	0				

●2018年4月4日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国3月のISM非製造業景況指数 *ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値	*交付税特別会計借入 (10,500億円、4/12借入)
-------------------	--	---------------------------------

◆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