

Central Daily Market Report

2018年4月5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4月5日		2018年4月6日		2018年4月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		300		1,000	
財政	▲ 31,400		5,400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 31,000		5,700		▲ 3,000	
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					1,600	▲ 2,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入			10,700			
CP等買入		▲ 400		▲ 200		
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			100			
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 31,300		21,300		▲ 3,600	
当座預金残高	3,758,700		3,780,000		3,776,400	
準備預金残高	3,306,800					
積み終了先	3,306,700				4月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,306,700				積数	
非準備預金先	451,900				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	99.96%	日数	67.74%		

●2018年4月5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、信託業態中心の調達で▲0.073~▲0.045%での出合いが中心となった。一巡後も概ね横ばい圏で推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関してはショートタームでロール案件中心の取引が見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/6-4/9)は▲0.110~▲0.100%程度、S/N(4/9-4/10)は▲0.115~▲0.100%程度で出合いが見られた。S/Nは今週二度目の短国発行日にあったものの、▲0.10%近辺ではビッドが厚く入ったことで、昨日までと同水準での引合いを続けることとなった。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▲0.142~▲0.135%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1355%、按分落札利回▲0.1303%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは、▲0.144~▲0.14%の出合いと強含みで推移した。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は少額の案件が中心で、全体の発行額は600億円程度と閑散。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日2,500億円で実施されたCP等買入オペは、平均レート0.002%、按分レート▲0.007%といずれも前回比(平均▲0.029%・按分▲0.038%)で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/4/5	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.115	0.035	0.010	21,645.42	325.87	106.78-80	107.05-07	
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.109							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.114							
2W							-	▲ 0.115							
3W							-	▲ 0.125							
1M							-	▲ 0.132							
3M							▲ 0.142	▲ 0.140							
6M							▲ 0.136	▲ 0.153							
1Y							▲ 0.141	▲ 0.162							
										日付	3/29	3/30	4/2	4/3	4/4
										日銀当預残	3,764,400	3,782,900	3,784,700	3,781,100	3,790,000
										準備預金残	3,308,700	3,343,200	3,328,000	3,331,600	3,334,500
										マネタリーベース	4,852,100	4,870,500	4,871,400	4,866,700	4,874,900
										無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.063%
										コール市場残高	111,151	53,258	93,841	97,617	100,069
										うち無担	94,579	43,761	80,267	83,455	83,225
										うちO/N	67,539	33,311	60,217	61,560	59,050
										うち有担	16,572	9,497	13,574	14,162	16,844

●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)	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	749	-	43,800	2018/4/9	2018/7/9	201,923.0	35,451.40	100.0325	▲0.1303%	69.9746%	100.0338	▲0.1355%	8,348.0
流動性供給	259	-	5,000	2018/4/9		12,422.0	4,995.00		0.0080%	41.8655%		0.0020%	

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/4/9	2018/4/23		1,602	1,602				
CP等買入	2,500	2018/4/10			7,860	2,485	▲0.007		0.002	26.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	79,180	2018/4/5	2018/4/6		10	10		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月6日の予定

*2月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比+0.3%)	*米国2月の消費者信用残高 *米国3月の雇用統計	*国庫短期証券(750回)入札 (6ヶ月、23,000億円、4/10発行)
*2月の毎月勤労統計調査速報		
*2月の景気動向指数速報		
*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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