

Central Daily Market Report

2018年4月6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4月6日 需給速報	2018年4月9日 需給予想	2018年4月10日 当社予想
銀行券	400	1,000	1,000
財政	5,300	▲4,900	▲4,000
資金過不足	5,700	▲3,900	▲3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		6,300
CP等買入		▲200	2,500
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	100	1,000	
国債補充供給	▲100		100
当預増減	21,200	▲3,400	5,800
当座預金残高	3,779,900	3,776,500	3,782,300
準備預金残高	3,323,500		
積み終了先	3,323,400		4月9日以降の残り所要積立額
超過準備	3,323,400		積数
非準備預金先	456,400		1日平均
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,064,000
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			77.42%

●2018年4月6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▲0.07~▲0.04%での出会いが中心となった。週末要因もあって昨日より堅調な地合いであった。一巡後も概ね横ばい圏で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/9-4/10)は▲0.120~▲0.110%程度、S/N(4/10-4/11)は▲0.130~▲0.115%程度で出会いが見られた。S/Nは今週三度目の短国発行日にあつたものの、引き続き▲0.10%近辺ではビッドが厚く入つたため、レートは昨日よりも低下した水準での出会いとなった。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、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.14%から▲0.155%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1594%、按分落札利回▲0.1534%と強い結果となった。セカンダリーでは、ショートカバーから▲0.20~▲0.18%で出合った。この他に、3M物が▲0.1425~▲0.14%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は10日発行となり、銘柄数には広がりが見られなかったものの、鉄鋼、小売、ノンバンク業態等からまとまった発行が見られ、総額2,700億円程度に膨らんだ。発行レートは一部銘柄で強めの出会いが見られたが、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/4/6	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	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)
単位:%							売買参考統計値	平均値	0.035	0.000	21,567.52	▲77.90	107.09-11	107.40-41
O/N	▲0.073	0.001	▲0.059				-	▲0.116						
T/N	▲0.030	0.000	▲0.018				-	▲0.119						
S/N							-	-						
1W	▲0.045	0.180	▲0.035				-	▲0.123						
2W							-	▲0.124						
3W			0.035				-	▲0.134						
1M							-	▲0.137						
3M							▲0.141	▲0.143						
6M							▲0.172	▲0.152						
1Y							▲0.143	▲0.162						
									日付	3/30	4/2	4/3	4/4	4/5
									日銀当預残	3,782,900	3,784,700	3,781,100	3,790,000	3,758,700
									準備預金残	3,343,200	3,328,000	3,331,600	3,334,500	3,306,800
									マネタリーベース	4,870,500	4,871,400	4,866,700	4,874,900	4,843,100
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.063%	▲0.062%
									コール市場残高	53,258	93,841	97,617	100,069	104,574
									うち無担	43,761	80,267	83,455	83,225	82,992
									うちO/N	33,311	60,217	61,560	59,050	57,947
									うち有担	9,497	13,574	14,162	16,844	21,582

●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)
国庫短期証券	750	-	23,000	2018/4/10	2018/10/10	133,041.0	18,688.00	100.0770	▲0.1534%	35.2000%	100.0800	▲0.1594%	4,312.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/4/10			4,363	503	0.005		0.006	12.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/4/10			9,799	2,505	▲0.003		▲0.002	26.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/10			10,395	3,304	0.003		0.004	64.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,000	2018/4/6	2018/4/9		56	56		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	26,816	2018/4/6	2018/4/9		19	19		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月9日の予定

- *2月の国際収支
- *3月の消費動向調査
- *3月の景気ウォッチャー調査

◆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