

Central Daily Market Report

2018年4月9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9日		2018年4月10日		2018年4月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		800		1,000	
財政	▲ 4,500		▲ 5,300		2,000	
資金過不足	▲ 3,500		▲ 4,500		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			6,400		7,100	
CP等買入			2,500	▲ 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						
E T F買入	1,000		400			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 3,100		4,700		15,100	
当座預金残高	3,776,800		3,781,500		3,796,600	
準備預金残高	3,322,500					
積み終了先	3,322,400				4月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,322,400				積数	
非準備預金先	454,300				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	99.98%	日数	80.65%		

●2018年4月9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▲0.065~▲0.045%での出合いが中心となった。積み終盤ということもあり堅調な展開が続き、一巡後も概ね横ばい圏で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は出合い閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(4/10-4/11)は▲0.135~▲0.125%程度、S/N(4/11-4/12)は▲0.145~▲0.14%程度で出合いが見られた。S/Nは、買入オペの実施を受けて、前日比でレート低下して出合った。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、10Y336~350、20Y164、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、短国買入オペが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が1兆5,518億円とやや多かったものの、平均落札利回較差▲0.004%、按分落札利回較差▲0.007%としっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.152~▲0.145%、6M物が▲0.174~▲0.172%、1Y物が▲0.15%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額150億円程度に対して、発行総額は300億円程度と若干の発行超であった。案件数が少なく全般的に閑散としたマーケットとなった。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

2018/4/9	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.140	0.030	▲ 0.005	21,678.26	110.74	106.95-96	107.09-10
T/N			0.000				-	▲ 0.134						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.135						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.137						
3W	▲ 0.012	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.148						
1M	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.148	▲ 0.147						
6M							▲ 0.170	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.163						
									日付	4/2	4/3	4/4	4/5	4/6
									日銀当預残	3,784,700	3,781,100	3,790,000	3,758,700	3,779,900
									準備預金残	3,328,000	3,331,600	3,334,500	3,306,800	3,323,500
									マネタリーベース	4,871,400	4,866,700	4,874,900	4,843,100	4,864,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.067%	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.059%
									コール市場残高	93,841	97,617	100,069	104,574	101,737
									うち無担	80,267	83,455	83,225	82,992	87,106
									うちO/N	60,217	61,560	59,050	57,947	60,526
									うち有担	13,574	14,162	16,844	21,582	14,631

●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)	応募率(%)	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
国庫短期証券買入	5,000	2018/4/11			15,518	5,002	▲0.007		▲0.004	54.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/4/11			12,832	4,507	▲0.004		▲0.003	17.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/4/11			4,580	1,910	▲0.008		▲0.007	68.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/4/11			2,460	708	▲0.007		▲0.006	9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	65,000	2018/4/9	2018/4/10		60	60		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月10日の予定

*米国2月の卸売売上高	*流動性供給入札(6,000億円、4/12発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、4/19借入)
*米国3月の生産者物価指数		

◆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