

Central Daily Market Report

2018年4月10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10日		2018年4月11日		2018年4月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		400		0	
財政	▲ 6,000		▲ 600		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 5,200		▲ 200		▲ 5,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	6,400		7,600			
CP等買入	2,500 ▲ 200		▲ 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		1,400			
国債補完供給	▲ 100 100		100			
当預増減	3,900		13,800		▲ 5,000	
当座預金残高	3,780,700		3,794,500		3,789,500	
準備預金残高	3,320,200					
積み終了先	3,320,100		4月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,320,100		積数		500	
非準備預金先	460,500		1日平均		100	
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	83.87%		

●2018年4月10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、信託業態が主な調達先となり、▲0.065~▲0.05%での出合いが中心となった。積みの調整から調達意欲が強い地合いとなり、一巡後は▲0.06%前後で散発的な出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/11-4/12)は▲0.185~▲0.18%程度、S/N(4/12-4/13)は▲0.19~▲0.17%程度で出合いが見られた。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、20Y164、30Y58などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

アウトライト市場は、動意なく閑散で、3M物で▲0.16~▲0.158%の出合いが見られた程度であった。

<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200億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超であった。石油・不動産業態において大型案件が見られたものの、案件数は膨らまず落ち着い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

2018/4/10	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.154	0.030	0.000	21,794.32	116.06	106.74-76	106.90-91
T/N			0.000				-	▲ 0.185						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.047				-	▲ 0.169						
2W	▲ 0.060	▲ 0.045	▲ 0.055				-	▲ 0.167						
3W							-	▲ 0.181						
1M							-	▲ 0.183						
3M							▲ 0.154	▲ 0.155						
6M							▲ 0.161	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.164						
									日付	4/3	4/4	4/5	4/6	4/9
									日銀当預残	3,781,100	3,790,000	3,758,700	3,779,900	3,776,800
									準備預金残	3,331,600	3,334,500	3,306,800	3,323,500	3,322,500
									マネタリーベース	4,866,700	4,874,900	4,843,100	4,864,000	4,859,900
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.059%	▲0.058%
									コール市場残高	97,617	100,069	104,574	101,737	96,537
									うち無担	83,455	83,225	82,992	87,106	80,924
									うちO/N	61,560	59,050	57,947	60,526	54,594
									うち有担	14,162	16,844	21,582	14,631	15,613

●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)
流動性供給	260	-	6,000	2018/4/12		23,366.0	5,982.00		0.0000%	32.0974%		▲0.0020%	
交付税特会	-	-	10,500	2018/4/19	2018/10/19	196,742.0	10,500.08		0.0000%	5.3697%		0.0000%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2018/4/10	2018/4/11		59	59		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/4/12	2018/4/19	2.19	0	0				

●2018年4月11日の予定

*2月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲2.5%)
*3月の企業物価指数

*米国3月の財政収支
*米国3月の消費者物価指数

◆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