

Central Daily Market Report

2018年4月11日(水)

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11日 需給速報	2018年4月12日 需給予想	2018年4月13日 当社予想
銀行券	400	▲ 900	▲ 1,000
財政	▲ 800	▲ 5,900	78,000
資金過不足	▲ 400	▲ 6,800	77,000
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	5,000		
国債買入	7,600		10,300
CP等買入		▲ 100	▲ 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	1,400		
国債補完供給	▲ 200	100	200
当預増減	13,400	▲ 6,700	87,300
当座預金残高	3,794,100	3,787,400	3,874,700
準備預金残高	3,307,000		
積み終了先	3,306,900		4月12日以降の残り所要積立額
超過準備	3,306,900		積数
非準備預金先	487,100		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	99.99%	日数
			87.10%

●2018年4月11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、▲0.06~▲0.045%での出会いが中心となった。引き続き調達ニーズの強い展開となり、一巡後もほぼ同水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物はロール案件中心で散発的に出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/12-4/13)は▲0.165~▲0.135%程度、S/N(4/13-4/16)は▲0.18~▲0.15%程度で出会いが見られた。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>

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物の入札を控えて様子見閑散な中、3M物で▲0.162%の出会いが見られた。なお、明日入札の3M物のWI取引では▲0.17%の強めの出会いが見られた。

<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1,100億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と発行超であった。輸送用機器業態において超大型案件が見られ、案件数も膨らみ比較的活況な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

2018/4/11	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.145	0.025	▲ 0.005	21,687.10	▲ 107.22	107.13-14	107.00-01
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.042				-	▲ 0.149						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.048				-	▲ 0.158						
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.022				-	▲ 0.160						
3W							-	▲ 0.187						
1M							-	▲ 0.188						
3M							▲ 0.155	▲ 0.156						
6M							▲ 0.157	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.165						
									日付	4/4	4/5	4/6	4/9	4/10
									日銀当預残	3,790,000	3,758,700	3,779,900	3,776,800	3,780,700
									準備預金残	3,334,500	3,306,800	3,323,500	3,322,500	3,320,200
									マネタリーベース	4,874,900	4,843,100	4,864,000	4,859,900	4,863,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.055%
									コール市場残高	100,069	104,574	101,737	96,537	102,534
									うち無担	83,225	82,992	87,106	80,924	87,904
									うちO/N	59,050	57,947	60,526	54,594	60,884
									うち有担	16,844	21,582	14,631	15,613	14,630

●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)	応募額(億円)	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/4/13			11,412	2,505	0.003		0.004	10.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/13			14,124	3,304	0.002		0.003	30.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/4/13			12,479	4,506	0.000		0.001	14.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	17,735	2018/4/11	2018/4/12		201	201		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年4月12日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(=地域経済報告) *3月のマネーストック	*国庫短期証券(751回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/16発行)	*30年利付国債入札 (7,000億円、4/16発行) *エネルギー対策借入 (8,500億円、4/20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