

# Central Daily Market Report

2018年4月12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12日		2018年4月13日		2018年4月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 500			1,000
財政	▲ 6,400		77,100			▲ 22,000
資金過不足	▲ 7,300		76,600			▲ 21,000
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					1,500	▲ 1,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
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			700			
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 7,200		87,300			▲ 20,800
当座預金残高	3,786,900		3,874,200			3,853,400
準備預金残高	3,316,000					
積み終了先	3,315,900				4月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,315,900				積数	300
非準備預金先	470,900				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	90.32%		

## ●2018年4月12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、▲0.055~▲0.045%で積みの調整を意識した堅調な出合いとなった。一巡後も引き続き同程度の水準で推移し、本日の取引を終了した。ターム物の出合いはロール案件中心の取引であった。

### <レポ市場>

GC T/N(4/13-4/16)は▲0.125~▲0.105%程度、S/N(4/16-4/17)は▲0.115~▲0.11%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>

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▲0.16%から▲0.17%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1685%、按分落札利回▲0.1625%とWI取引を反映し、強い結果となった。セカンダリーでは、▲0.185~▲0.18%の出合いと強含みで推移した。

### <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800億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と発行超であった。案件数は膨らまなかったものの、電気機器業態において超大型案件が見られたことで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。本日はCP等買入オペアが2,500億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.008%・全取レート▲0.013%と、前回(平均0.002%・按分▲0.007%)比でいずれも低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/4/12	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	▲ 0.047				-	▲ 0.137	0.030	0.005	21,660.28	▲ 26.82	106.82-83	106.90-91
T/N			0.000				-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.046				-	▲ 0.143						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.159						
3W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.048				-	▲ 0.185						
1M	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.041				-	▲ 0.192						
3M							▲ 0.178	▲ 0.157						
6M							▲ 0.152	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.165						
									日付	4/5	4/6	4/9	4/10	4/11
									日銀当預残	3,758,700	3,779,900	3,776,800	3,780,700	3,794,100
									準備預金残	3,306,800	3,323,500	3,322,500	3,320,200	3,307,000
									マネタリーベース	4,843,100	4,864,000	4,859,900	4,863,000	4,876,000
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.059%	▲0.058%	▲0.055%	▲0.053%
									コール市場残高	104,574	101,737	96,537	102,534	99,331
									うち無担	82,992	87,106	80,924	87,904	85,318
									うちO/N	57,947	60,526	54,594	60,884	58,463
									うち有担	21,582	14,631	15,613	14,630	14,013

## ●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	751	-	43,800	2018/4/16	2018/7/17	188,854.0	35,452.7	100.0410	▲0.1625%	76.6152%	100.0425	▲0.1685%	8,347.0
30年利付国債	58	0.80%	7,000	2018/4/16	2048/3/20	24,510.0	5,651.0	102.0500	0.7160%	19.1148%	102.1100	0.7140%	1,337.0
エネルギー対策	-	-	8,500	2018/4/20	2019/4/22	120,210.0	8,499.97		0.0000%	7.0710%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/4/16	2018/5/1		1,460	1,460				
CP等買入	2,500	2018/4/17			6,112	2,495		▲0.013	▲0.008	

## ●2018年4月13日の予定

\*2月の特定サービス産業動態統計速報

\*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報

◆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