

Central Daily Market Report

2018年4月13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13日 需給速報		2018年4月16日 需給予想		2018年4月17日 当社予想	
銀行券	▲ 400		700		1,000	
財政	77,900		▲ 20,700		2,000	
資金過不足	77,500		▲ 20,000		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			1,500	▲ 1,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					2,500	
国債買入	10,400				8,400	
CP等買入		▲ 400		▲ 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	700		100			
国債補充供給	▲ 1,100			1,100		
当預増減	87,100		▲ 18,800		16,400	
当座預金残高	3,874,000		3,855,200		3,871,600	
準備預金残高	3,390,300					
積み終了先	3,390,300		4月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,390,200		積数		3,000,800	
非準備預金先	483,700		1日平均		100,000	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,000,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2018年4月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は実質的な積みの最終日となり、引き続き強い地合いとなった。地銀、信託、証券業態が主な調達先となり、出合いの中心レートは▲0.055~▲0.04%であった。一巡後は、積みの最終調整による散発的な出合いが▲0.045~▲0.035%前後で見られ、本日の取引を終えた。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(4/16-4/17)は▲0.180~▲0.115%程度、S/N(4/17-4/18)は▲0.175~▲0.160%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、短国買入オペが事前予想通りの2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回り較差▲0.002%、按分落札利回り較差▲0.006%と、好需給を反映してしっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.185~▲0.183%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50億円程度に対して、発行総額は200億円程度と僅かに発行超であった。発行案件が少なく、一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

2018/4/13	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.123		0.030	0.000	21,778.74	118.46	107.25-26	107.64-65	
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.153								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.043				-	▲ 0.149								
2W			▲ 0.055				-	▲ 0.174								
3W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.194								
1M	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.194								
3M								▲ 0.180	▲ 0.159							
6M								▲ 0.150	▲ 0.157							
1Y								▲ 0.150	▲ 0.165							
											日付	4/6	4/9	4/10	4/11	4/12
											日銀当預残	3,779,900	3,776,800	3,780,700	3,794,100	3,786,900
											準備預金残	3,323,500	3,322,500	3,320,200	3,307,000	3,316,000
											マネタリーベース	4,864,000	4,859,900	4,863,000	4,876,000	4,869,700
											無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.055%	▲ 0.053%	▲ 0.047%
											コール市場残高	101,737	96,537	102,534	99,331	114,004
											うち無担	87,106	80,924	87,904	85,318	96,754
											うちO/N	60,526	54,594	60,884	58,463	66,499
											うち有担	14,631	15,613	14,630	14,013	17,250

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第I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	2,500	2018/4/17			8,621	2,500	▲0.006		▲0.002	70.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/4/17			13,087	2,508	0.003		0.003	63.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/17			13,735	3,304	0.003		0.003	78.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/4/17			5,427	1,908	0.003		0.004	72.6
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/4/17			2,192	704	0.002		0.003	71.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	65,144	2018/4/13	2018/4/16		978	978		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,554	2018/4/13	2018/4/16		65	65		▲0.500	▲0.500	

●2018年4月16日の予定

*月例経済報告	*米国2月の企業在庫
*2月の石油等消費動態統計	*米国3月の小売売上高

◆本資料は信頼できるとさ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よう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ことがあります。金融商品取引法に基づきお読みする書面や目録見書をよくお読みください。