

Central Daily Market Report

2018年4月16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16日		2018年4月17日		2018年4月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		300		▲ 1,000	
財政	▲ 21,900		2,800		3,000	
資金過不足	▲ 21,300		3,100		2,000	
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			8,600			
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 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	100					
国債補完供給	▲ 1,100	1,100		1,100		
当預増減	▲ 21,200		17,700		2,000	
当座預金残高	3,852,800		3,870,500		3,872,500	
準備預金残高	3,374,900					
積み終了先	2,133,300		4月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	928,000		積数		553,900	
非準備預金先	477,900		1日平均		19,100	
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	81.54%	日数	3.33%		

●2018年4月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積みの初日のため調達需要が落ち着き、前日比でレートが低下した。立ち上がりは地銀・証券・信託業態の調達を中心に▲0.07~▲0.05%近辺の幅広いレンジで出合いが見られた。一巡後はビッドサイドが閑散気味となり、▲0.08%台での取引も行われた。ターム物は1W~2Wのショートタームで▲0.045~▲0.04%の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/17-4/18)は、▲0.205~▲0.125%程度での出合い。S/N(4/18-4/19)は、▲0.17~▲0.16%程度で出合い。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、動意なく閑散で、3M物で▲0.185%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170億円程度に対して、発行総額は250億円程度と発行超であった。案件数は少なく、盛り上がり欠ける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

2018/4/16	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.140	0.035	0.005	21,835.53	56.79	107.51-53	107.20-22
T/N			0.000				-	▲ 0.151						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.025	0.020	0.005				-	▲ 0.192						
3W							-	▲ 0.198						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.198						
3M							▲ 0.177	▲ 0.159						
6M							▲ 0.150	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.165						
									日付	4/9	4/10	4/11	4/12	4/13
									日銀当預残	3,776,800	3,780,700	3,794,100	3,786,900	3,874,000
									準備預金残	3,322,500	3,320,200	3,307,000	3,316,000	3,390,300
									マネタリーベース	4,859,900	4,863,000	4,876,000	4,869,700	4,957,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.055%	▲ 0.053%	▲ 0.047%	▲ 0.044%
									コール市場残高	96,537	102,534	99,331	114,004	117,613
									うち無担	80,924	87,904	85,318	96,754	96,834
									うちO/N	54,594	60,884	58,463	66,499	67,314
									うち有担	15,613	14,630	14,013	17,250	20,779

●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	応募総額(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)	50,986	2018/4/16	2018/4/17		1,052	1,052		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第84回	2018/4/20	2019/4/19	0	1,068
被災地金融支援オペ(熊本)	第23回	2018/4/20	2019/4/19	0	200

●2018年4月17日の予定

*米国3月の住宅着工件数	*5年利付国債入札(20,000億円、4/19発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、4/26借入)
*米国3月の鉱工業生産・設備稼働率		

◆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