

Central Daily Market Report

2018年4月17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17日		2018年4月18日		2018年4月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 700		▲ 2,000	
財政	700		3,300		▲ 18,000	
資金過不足	1,000		2,600		▲ 20,000	
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	2,500					
国債買入	8,600					
CP等買入	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			700			
国債補完供給	▲ 2,900	1,100	2,900			
当預増減	12,700		6,200		▲ 20,000	
当座預金残高	3,865,500		3,871,700		3,851,700	
準備預金残高	3,376,800					
積み終了先	3,275,500					4月18日以降の残り所要積立額
超過準備	2,921,400					積数 98.400
非準備預金先	488,700					1日平均 3.500
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	96.72%	日数	6.67%		

●2018年4月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み期間の前半であることから取り急ぎ動きも無く、前日に引き続きやや軟調な展開となった。立ち上がりは地銀・証券・信託業態の調達を中心に▲0.075~▲0.05%近辺の幅広いレンジで出合いが見られた。一巡後は取り下がり、▲0.085~▲0.07%のレンジで推移した。ターム物は1W~2Wのショートタームで引き合いが散見されたが、出合いは閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(4/18-4/19)は、▲0.165~▲0.155%程度での出合い。S/N(4/19-4/20)は、▲0.155~▲0.145%程度での出合い。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.18%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。発行市場は小売・自動車業態からまとまった発行が見られ、償還総額160億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と大幅な発行超となった。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

2018/4/17	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	▲ 0.063				-	▲ 0.149	0.035	0.000	21,847.59	12.06	107.06-07	106.99-00
T/N			0.000				-	▲ 0.158						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.047	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.033				-	▲ 0.201						
3W							-	▲ 0.199						
1M							-	▲ 0.196						
3M			0.001				▲ 0.177	▲ 0.159						
6M							▲ 0.150	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.165						
									日付	4/10	4/11	4/12	4/13	4/16
									日銀当預残	3,780,700	3,794,100	3,786,900	3,874,000	3,852,800
									準備預金残	3,320,200	3,307,000	3,316,000	3,390,300	3,374,900
									マネタリーベース	4,863,000	4,876,000	4,869,700	4,957,400	4,935,500
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.053%	▲0.047%	▲0.044%	▲0.059%
									コール市場残高	102,534	99,331	114,004	117,613	99,277
									うち無担	87,904	85,318	96,754	96,834	84,266
									うちO/N	60,884	58,463	66,499	67,314	56,151
									うち有担	14,630	14,013	17,250	20,779	15,011

●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)
5年利付国債	135	0.10%	20,000	2018/4/19	2023/3/20	71,448.0	16,239.0	101.0800	▲0.1180%	95.5045%	101.0900	▲0.1200%	3,754.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/4/26	2018/10/25	189,010.0	10,500.09		0.0000%	5.5554%		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)	29,740	2018/4/17	2018/4/18		2,725	2,725		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	18,489	2018/4/17	2018/4/18		98	98		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/4/19	2018/4/26	2.2	0	0				

●2018年4月18日の予定

*3月の貿易統計	*米国ページブック *英国3月の消費者物価指数 *ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(752回)入札 (1年、21,000億円、4/20発行)
----------	--------------------------------------------------	-----------------------------------------

◆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