

Central Daily Market Report

2018年4月18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18日		2018年4月19日		2018年4月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	3,000		▲ 18,200		▲ 5,000	
資金過不足	2,300		▲ 19,800		▲ 7,000	
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						
国債買入					11,300	
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					1,300	▲ 1,100
社債等買入						
E T F 買入	700		200			
国債補完供給	▲ 3,000	2,900		3,000		
当預増減	2,900		▲ 16,700		4,500	
当座預金残高	3,868,400		3,851,700		3,856,200	
準備預金残高	3,386,700					
積み終了先	3,352,400				4月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,328,400				積数	40,100
非準備預金先	481,700				1日平均	1,500
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	98.66%	日数	10.00%		

●2018年4月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、今週に入って徐々にレートが低下している流れを引き継ぎ、軟調な展開であった。立ち上がりは地銀・証券・信託・外銀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、▲0.086~▲0.06%のレンジの出合いを中心に推移した。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T/N(4/19-4/20)は、▲0.185~▲0.16%程度での出合い。S/N(4/20-4/23)は、▲0.185~▲0.17%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、1Y物の入札が実施された。WI取引での▲0.18~▲0.17%の強めの出合いを受けて、平均落札利回▲0.1796%、按分落札利回▲0.1757%と事前予想よりも強い結果となった。セカンダリーでは、▲0.19~▲0.185%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20日発行にあたり、卸売・化学業態から大型発行が見られ、償還総額850億円に対して、発行総額は2,500億円程度と発行超の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

2018/4/18	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.150	0.030	▲ 0.005	22,158.20	310.61	107.02-03	107.30-31
T/N			0.000				-	▲ 0.166						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.230	▲ 0.010				-	▲ 0.161						
2W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.039				-	▲ 0.210						
3W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.206						
1M	▲ 0.050	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.199						
3M							▲ 0.169	▲ 0.161						
6M							▲ 0.150	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.184	▲ 0.166						
									日付	4/11	4/12	4/13	4/16	4/17
									日銀当預残	3,794,100	3,786,900	3,874,000	3,852,800	3,865,500
									準備預金残	3,307,000	3,316,000	3,390,300	3,374,900	3,376,800
									マネタリーベース	4,876,000	4,869,700	4,957,400	4,935,500	4,948,000
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.047%	▲0.044%	▲0.059%	▲0.063%
									コール市場残高	99,331	114,004	117,613	99,277	94,819
									うち無担	85,318	96,754	96,834	84,266	80,093
									うちO/N	58,463	66,499	67,314	56,151	51,398
									うち有担	14,013	17,250	20,779	15,011	14,726

●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	752	-	21,000	2018/4/20	2019/4/22	115,985.0	17,001.00	100.1770	▲0.1757%	42.0000%	100.1810	▲0.1796%	3,999.0

●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	2018/4/20			10,437	2,507	0.002		0.003	28.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/20			11,027	3,306	▲0.002		▲0.001	29.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/4/20			17,659	4,507	▲0.002		▲0.002	68.8
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/4/20			3,226	1,004	▲0.100		▲0.214	33.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	18,489	2018/4/18	2018/4/19		2,909	2,909		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月19日の予定

*国庫短期証券(753回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/23発行)	*20年利付国債入札 (10,000億円、4/23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