

Central Daily Market Report

2018年4月19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19日		2018年4月20日		2018年4月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	▲ 19,200		1,400		8,000	
資金過不足	▲ 20,800		0		6,000	
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					2,000	▲ 1,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
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				▲ 300		
E T F買入	200					
国債補完供給		3,000				
当預増減	▲ 17,700		10,900		6,400	
当座預金残高	3,850,700		3,861,600		3,868,000	
準備預金残高	3,364,200					
積み終了先	3,351,200				4月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,344,400				積数	20,300
非準備預金先	486,500				1日平均	800
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	99.32%	日数	13.33%		

●2018年4月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日と同様ビッドサイドの参加者が限られており、軟調な展開で推移した。立ち上がりは地銀・証券・信託・外銀業態の調達を中心に▲0.085~▲0.05%近辺の幅広いレンジで出会いが見られた。一巡後は取り下がり、▲0.086~▲0.075%のレンジの出会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。本日の共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、応札額1,952億円(期落ち額1,602億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(4/20-4/23)は、▲0.175~▲0.16%程度での出会い。S/N(4/23-4/24)は、▲0.165~▲0.155%程度での出会い。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、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▲0.17%から▲0.185%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1804%、按分落札利回▲0.1744%とWI取引を反映し、強い結果となった。セカンダリーでは、▲0.19%で少額出合った後は、引けにかけて▲0.18%売り気配になるなど小甘く推移した。この他に1Y物が▲0.185%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。発行市場はノンバンク・鉄鋼業態からまとまった額での調達が見られ、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。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

2018/4/19	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	▲ 0.069				-	▲ 0.152	0.035	0.005	22,191.18	32.98	107.35-36	107.28-30
T/N			0.000				-	▲ 0.170						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.049				-	▲ 0.204						
2W	▲ 0.055	▲ 0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.216						
3W			0.001				-	▲ 0.211						
1M	▲ 0.055	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.204						
3M							▲ 0.180	▲ 0.164						
6M							▲ 0.150	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.181	▲ 0.168						
									日付	4/12	4/13	4/16	4/17	4/18
									日銀当預残	3,786,900	3,874,000	3,852,800	3,865,500	3,868,400
									準備預金残	3,316,000	3,390,300	3,374,900	3,376,800	3,386,700
									マネタリーベース	4,869,700	4,957,400	4,935,500	4,948,000	4,951,600
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.044%	▲0.059%	▲0.063%	▲0.063%
									コール市場残高	114,004	117,613	99,277	94,819	96,478
									うち無担	96,754	96,834	84,266	80,093	82,927
									うちO/N	66,499	67,314	56,151	51,398	53,392
									うち有担	17,250	20,779	15,011	14,726	13,551

●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	753	-	44,200	2018/4/23	2018/7/23	162,879.0	35,765.6	100.0435	▲0.1744%	3.4823%	100.0450	▲0.1804%	8,434.0
20年利付国債	164	0.50%	10,000	2018/4/23	2038/3/20	29,722.0	8,044.00	99.9000	0.5050%	3.4926%	100.0000	0.5000%	1,947.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/4/23	2018/5/7		1,952	1,952				
社債等買入	1,250	2018/4/25			1,742	1,250	▲0.235		▲0.179	16.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	37,685	2018/4/19	2018/4/20		8	8		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月20日の予定

*2月の第3次産業活動指数

*3月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.9%)

*交付税特別会計借入

(10,500億円、5/2借入)

◆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