

Central Daily Market Report

2018年4月23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23日		2018年4月24日		2018年4月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,700		▲ 3,000	
財政	2,100		▲ 7,900		10,000	
資金過不足	1,200		▲ 9,600		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	2,000	▲ 1,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入			7,200		6,600	
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100	1,300	
E T F買入						
国債補完供給	▲ 600	300		600		
当預増減	1,100		400		14,900	
当座預金残高	3,860,100		3,860,500		3,875,400	
準備預金残高	3,379,800					
積み終了先	3,378,600		4月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,377,900		積数		5,800	
非準備預金先	480,300		1日平均		300	
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	99.81%	日数	26.67%		

●2018年4月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週と同様に各業態の調達意欲が低く、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▲0.086~▲0.06%のレンジで出合いが見られたが、調達サイドの参加者が限られていたため、多くのオファーが出し残る状況となった。一巡後もビッドサイドの参加者はほとんど現れず、▲0.08%台で散発的な出合いが見られた程度であった。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(4/24-4/25)は、▲0.14~▲0.13%程度での出合い。S/N(4/25-4/26)は、▲0.145~▲0.14%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、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▲0.175~▲0.172%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場はノンバンク、卸売、不動産等の業態でまとまった額の発行が見られ、発行総額は1,300億円程度と償還総額の900億円弱を上回った。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/4/23	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	0.055	0.000	22,088.04	▲ 74.20	107.87-88	107.90-92
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.147						
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.134						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.048	▲ 0.057				-	▲ 0.205						
2W	▲ 0.055	▲ 0.050	▲ 0.053				-	▲ 0.195						
3W							-	▲ 0.186						
1M							-	▲ 0.180						
3M							▲ 0.172	▲ 0.164						
6M							▲ 0.150	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.166						
									日付	4/16	4/17	4/18	4/19	4/20
									日銀当預残	3,852,800	3,865,500	3,868,400	3,850,700	3,859,000
									準備預金残	3,374,900	3,376,800	3,386,700	3,364,200	3,362,300
									マネタリーベース	4,935,500	4,948,000	4,951,600	4,935,500	4,945,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.063%	▲ 0.063%	▲ 0.069%	▲ 0.070%
									コール市場残高	99,277	94,819	96,478	94,822	92,350
									うち無担	84,266	80,093	82,927	81,176	76,772
									うちO/N	56,151	51,398	53,392	52,101	46,937
									うち有担	15,011	14,726	13,551	13,646	15,578

●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年以下)	500	2018/4/25			2,728	504	0.002		0.003	18.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/4/25			10,409	2,505	0.008		0.008	71.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/25			10,549	3,305	0.008		0.008	74.5
国債買入(物価連動債)	250	2018/4/25			1,461	251	▲ 0.160		▲ 0.166	42.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,723	2018/4/23	2018/4/24		389	389		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,617	2018/4/23	2018/4/24		159	159		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年4月24日の予定

*3月の企業向けサービス価格指数	*米国2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札
*2月の景気動向指数改訂状況	*米国3月の新築一戸建て販売件数	(21,000億円、5/15発行)
	*米国4月のCB消費者信頼感指数	

◆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