

Central Daily Market Report

2018年4月24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24日		2018年4月25日		2018年4月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,900		▲ 2,000		▲ 3,000	
財政	▲ 11,000		11,200		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 12,900		9,200		▲ 5,000	
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	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	▲ 500		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	600		300		
当預増減	▲ 3,200		16,700		▲ 5,000	
当座預金残高	3,856,900		3,873,600		3,868,600	
準備預金残高	3,377,600					
積み終了先	3,376,500					
超過準備	3,376,500					
非準備預金先	479,300					
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		99.84%		日数	30.00%

●2018年4月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日に引き続き調達サイドの参加者が限定的で、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少なく量も限られていたため、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、閑散なまま一日の取引を終えた。ターム物は1W物から2W物のショートタームで、▲0.06%近辺の引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/25-4/26)は、▲0.145~▲0.135%程度での出合い。S/N(4/26-4/27)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、動意なく閑散で、3M物が▲0.175~▲0.172%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、ファイナンス業態で1,000億円弱の大ロットの発行が見られた他、卸売、不動産、鉄鋼、パルプ・紙業態でもまとまった額の発行が散見された。その結果、償還総額1,900億円弱に対し、発行総額は4,800億円程度まで膨らみ、活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏で推移しているものの、発行頻度が低い銘柄や発行残高が少ない銘柄で低めの出合いが見られた。本日はCP等買入オペが2,500億円でオファーされた。結果は平均落札レート0.002%、按分落札レート▲0.005%と、前回比(平均▲0.008%、按分▲0.013%)で平均、按分ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/4/24	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	▲ 0.072				-	▲ 0.140	0.050	▲ 0.005	22,278.12	190.08	108.77-78	108.88-90
T/N			0.000				-	▲ 0.141						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.183						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.177						
3W			0.035				-	▲ 0.170						
1M							-	▲ 0.169						
3M							▲ 0.172	▲ 0.163						
6M							▲ 0.150	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.166						
									日付	4/17	4/18	4/19	4/20	4/23
									日銀当預残	3,865,500	3,868,400	3,850,700	3,859,000	3,860,100
									準備預金残	3,376,800	3,386,700	3,364,200	3,362,300	3,379,800
									マネタリーベース	4,948,000	4,951,600	4,935,500	4,945,100	4,947,100
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.071%
									コール市場残高	94,819	96,478	94,822	92,350	88,637
									うち無担	80,093	82,927	81,176	76,772	73,080
									うちO/N	51,398	53,392	52,101	46,937	43,325
									うち有担	14,726	13,551	13,646	15,578	15,557

●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)
2年利付国債	388	0.10%	21,000	2018/5/15	2020/5/15	93,490.0	17,333.00	100.4700	▲0.1340%	97.5900%	100.4710	▲0.1340%	3,665.0

●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
CP等買入	2,500	2018/4/27			7,530	2,490	▲0.005		0.002	5.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2018/4/24	2018/4/25		230	230		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	29,971	2018/4/24	2018/4/25		71	71		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/4/26	2018/5/10	2.2	0	0				

●2018年4月25日の予定

*特にありません。

◆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