

Central Daily Market Report

2018年4月27日(金)
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27日		2018年5月1日		2018年5月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,700		▲ 1,800		1,000	
財政	8,200		▲ 12,600		▲ 5,000	
資金過不足	4,500		▲ 14,400		▲ 4,000	
金融調節						
貸出	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
全店共通			2,400	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,600					
CP等買入	2,500	▲ 1,100		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 1,500	100		1,500		
当増増減	12,100		▲ 12,200		▲ 4,000	
当座預金残高	3,885,700		3,873,500		3,869,500	
準備預金残高	3,408,100					
積み終了先	3,407,800		5月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,407,800		積数		2,800	
非準備預金先	477,600		1日平均		200	
積み期間 (4/16~5/15) の所要準備額					3,008,500	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	50.00%		

●2018年4月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日までと同様に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~▲0.05%のレンジで出合いが見られた。一巡後もビッドサイドは閑散で、多くのオファーが出し残った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%近辺の運用ニーズが聞かれたものの、調達の参加者が少なく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(5/1-5/2) は、▲0.11~▲0.09%程度での出合い。S/N(5/2-5/7) は、決済短縮化の開始を控えて様子見姿勢が強い中、▲0.10~▲0.095%程度での出合いが見られた。SC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▲0.145%、1Y物が▲0.165%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は食料品、ノンバンク業態でまとまった額での調達が行われたものの案件数は膨らまず、償還総額300億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度となった。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

2018/4/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.115	0.050	▲ 0.005	22,467.87	148.26	109.30-31	109.39-40
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.035	▲ 0.047				-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.122						
3W							-	▲ 0.125						
1M			0.001				-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.145	▲ 0.150						
6M							▲ 0.147	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.161						
									日付	4/20	4/23	4/24	4/25	4/26
									日銀当預残	3,859,000	3,860,100	3,856,900	3,872,600	3,873,600
									準備預金残	3,362,300	3,379,800	3,377,600	3,394,000	3,388,000
									マネタリーベース	4,945,100	4,947,100	4,945,800	4,963,700	4,968,000
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.072%	▲0.071%
									コール市場残高	92,350	88,637	84,458	81,009	76,255
									うち無担	76,772	73,080	69,612	65,350	59,787
									うちO/N	46,937	43,325	39,337	35,000	31,197
									うち有担	15,578	15,557	14,846	15,659	16,468

●入札結果

名称	回数	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	棄分率	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。													

●オベ結果

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	応募総額(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)	142,968	2018/4/27	2018/5/1		1,395	1,395		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,971	2018/4/27	2018/5/1		11	11		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月30日の予定

*振替休日	*米国3月の個人所得・消費支出	*米国4月のシカゴPM景況感指数
-------	-----------------	------------------

●2018年5月1日の予定

*米国FOMC(1日目)	*米国3月の建設支出 *米国4月のISM製造業景況指数	*EURO祝日(Labour Day)
--------------	--------------------------------	---------------------

●日銀政策決定会合・結果

<p>●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。</p> <p>(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)</p> <p>短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。</p> <p>長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。</p> <p>(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)</p> <p>①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。</p> <p>②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。</p>

◆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