

●資金需給

単位：億円	2018年4月4日		2018年4月5日		2018年4月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		300		0	
財政	4,700		▲ 32,100		3,000	
資金過不足	5,400		▲ 31,800		3,000	
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					5,000	
国債買入	3,000				10,300	
CP等買入				▲ 400		
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	400					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	8,900		▲ 32,100		18,300	
当座預金残高	3,790,000		3,757,900		3,776,200	
準備預金残高	3,334,500					
積み終了先	3,334,300				4月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,334,300				積数 1,300	
非準備預金先	455,500				1日平均 100	
積み期間 (3/16~4/15) の所要準備額					3,053,200	
準備預金進捗率	実績 99.96%		日数 64.52%			

●短期金融市場関連指標

2018/4/4	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.117	0.025	0.005	21,319.55	27.26	106.44-45	106.20-22
T/N			0.000				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.045				-	▲ 0.112						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.040				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.050	0.000	▲ 0.038				-	▲ 0.131						
3M			0.001				▲ 0.136	▲ 0.141						
6M							▲ 0.136	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.162						

日付	3/28	3/29	3/30	4/2	4/3
日銀当預残	3,751,900	3,764,400	3,782,900	3,784,700	3,781,100
準備預金残	3,294,400	3,308,700	3,343,200	3,328,000	3,331,600
マネタリーベース	4,838,900	4,852,100	4,870,500	4,871,400	4,866,700
無担O/N加重平均	▲ 0.066%	▲ 0.066%	▲ 0.068%	▲ 0.067%	▲ 0.067%
コール市場残高	108,498	111,151	53,258	93,841	97,617
うち無担	88,762	94,579	43,761	80,267	83,455
うちO/N	61,012	67,539	33,311	60,217	61,560
うち有担	19,736	16,572	9,497	13,574	14,162

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/4/12	2018/10/11	207,722.0	10,500.23		0.0000%	5.0550%		0.0000%	

●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
国庫短期証券買入	5,000	2018/4/6			15,430	5,000	▲0.005		▲0.003	47.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/4/6			10,673	2,502	0.004		0.005	67.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/4/6			10,162	3,302	0.006		0.007	48.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/4/6			18,520	4,503	0.007		0.008	44.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	59,874	2018/4/4	2018/4/5		97	97		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,379	2018/4/4	2018/4/5		25	25		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月5日の予定

*米国2月の貿易収支	*国庫短期証券(749回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/9発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、4/9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論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