

Central Daily Market Report

2018年4月20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20日		2018年4月23日		2018年4月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 600		▲ 2,000	
財政	▲ 1,000		3,900		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 2,300		3,300		▲ 14,000	
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	11,500				7,100	
CP等買入		▲ 500		▲ 200		
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						
国債補充供給	▲ 300			300		
当預増減	8,300		3,800		▲ 4,400	
当座預金残高	3,859,000		3,862,800		3,858,400	
準備預金残高	3,362,300					
積み終了先	3,359,500		4月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,358,100		積数		7,700	
非準備預金先	496,700		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	99.74%	日数	23.33%		

●2018年4月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により全体的に調達意欲が低く、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・外銀業態の調達を中心に▲0.086~▲0.06%のレンジでの出会いが中心となった。一巡後はビッドが閑散となり、▲0.08%台での出会いが散発的に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(4/23-4/24)は、▲0.165~▲0.15%程度での出会い。S/N(4/24-4/25)は、▲0.165~▲0.135%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、短国買入オペアが2,500億円(前回と同額)でオフアされた。応札額が12,344億円と多く、平均、按分落札利回較差ともに+0.005%と小甘い結果となった。オペア後は3M物、1Y物がそれぞれ▲0.17%で出合うなど弱めの推移となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は卸売業態から大型の案件が見られ、償還総額1,200億円程度に対して、発行総額は1,750億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

2018/4/20	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.151		0.055	0.020	22,162.24	▲ 28.94	107.44-46	107.55-56		
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.159									
S/N							-	-									
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.221									
2W							-	▲ 0.218									
3W							-	▲ 0.206									
1M							-	▲ 0.203									
3M							▲ 0.172	▲ 0.166									
6M							▲ 0.150	▲ 0.156									
1Y							▲ 0.171	▲ 0.168									
												4/13	4/16	4/17	4/18	4/19	
												日銀当預残	3,874,000	3,852,800	3,865,500	3,868,400	3,850,700
												準備預金残	3,390,300	3,374,900	3,376,800	3,386,700	3,364,200
												マネタリーベース	4,957,400	4,935,500	4,948,000	4,951,600	4,935,500
												無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.059%	▲ 0.063%	▲ 0.063%	▲ 0.069%
												コール市場残高	117,613	99,277	94,819	96,478	94,822
												うち無担	96,834	84,266	80,093	82,927	81,176
												うちO/N	67,314	56,151	51,398	53,392	52,101
												うち有担	20,779	15,011	14,726	13,551	13,646

●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I非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	10,500	2018/5/2	2018/11/2	186,182.0	10,500.06		0.0000%	5.6398%		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	2,500	2018/4/24			12,344	2,500	0.005		0.005	84.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/4/24			11,410	4,512	0.008		0.009	96.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/4/24			4,401	1,902	0.011		0.012	40.5
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/4/24			1,920	706	0.010		0.011	96.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,969	2018/4/20	2018/4/23		221	221		▲0.600	▲0.600	

●2018年4月23日の予定

*米国3月の中古住宅販売

◆本資料は信頼できるとさ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よう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。