

Central Daily Market Report

2017年4月3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	2017年4月3日		2017年4月4日		2017年4月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,400		700		2,000	
財政	▲2,000		▲10,200		5,000	
資金過不足	▲600		▲9,500		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	3,000	▲3,100				
国債買現						
国債売現		10,000				
国庫短期証買入						
国債買入			11,400		3,700	
CP等買入		▲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						
ETF買入						
国債補完供給	▲2,800	24,200		2,800		
当預増減	30,500		4,700		10,700	
当座預金残高	3,458,700		3,463,400		3,474,100	
準備預金残高	3,088,200					
積み終了先	2,584,600					
超過準備	2,584,100					
非準備預金先	370,500					
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					2,250,200	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	61.29%		

●2017年4月3日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆4,000億円増加の260兆9,000億円(当座預金残高見込みは346兆円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.08~▲0.07%、証券業態から▲0.075~▲0.05%、地銀業態から▲0.05~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。新しい年度に入ったものの、各業態の調達意欲は限定的な中、▲0.075~▲0.02%の幅広いレンジで出合いが見られた。一巡後はビッドが閑散な状態となったため、レートが一段と低下し、▲0.08~▲0.03%のレンジで出合いが見られた。ターム物は、1W~1M物程度の期間で▲0.03~▲0.02%の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/4-4/5)は、▲0.05~▲0.04%程度の出合い。S/N(4/5-4/6)は、▲0.06~▲0.05%程度で出合いが見られた。S/Nは、目立った要因がなかったことから横ばい圏内で推移した。SCでは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、5Y129~131、10Y334~346、30Y50~54、40Y9などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移。アウトライ市場は短国買入オペ動向が不透明な中、明日から連続で行われる新発入札を控えて、様子見の状態が続いていた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場はスタート日が5・10日にあたり、鉄鋼・商社・ノンバンク業態で大型案件が散見されたため、償還総額1,200億円に対し、発行総額は1,900億円と発行超のマーケットとなった。発行レートは概ね低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/4/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考対値	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	
	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	▲0.085	0.001	▲0.056				-	▲0.053	0.070	0.005	18,983.23	73.97	111.26-28	111.42-43
T/N							-	▲0.043						
S/N							-	-						
1W	▲0.030	0.000	▲0.014				-	▲0.086						
2W	▲0.030	▲0.009	▲0.023				-	▲0.095						
3W							-	▲0.101						
1M	▲0.027	0.001	▲0.018				-	▲0.110						
3M			0.500				▲0.169	▲0.148						
6M							▲0.188	▲0.195						
1Y							▲0.186	▲0.216						
									日付	3/27	3/28	3/29	3/30	3/31
									日銀当預残	3,409,100	3,415,900	3,414,100	3,432,000	3,428,200
									準備預金残	3,047,300	3,069,700	3,073,400	3,088,600	3,075,600
									マネタリーベース	4,452,100	4,459,200	4,457,900	4,476,800	4,473,300
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.046%	▲0.060%
									コール市場残高	102,377	96,656	95,212	94,778	49,854
									うち無担	81,674	77,138	75,824	75,325	41,200
									うちO/N	49,453	53,299	52,548	54,991	33,420
									うち有担	20,703	19,518	19,388	19,453	8,654

●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)	700	2017/4/5			5,396	700	0.100		0.104	71.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/4/5			6,174	2,010	▲0.003		▲0.002	31.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/4/5			3,342	1,004	▲0.012		▲0.009	15.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,764	2017/4/3	2017/4/4		2,774	2,774		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/4/3	2017/4/4		0	0				

●2017年4月4日の予定

*3月実績/4月見込み財政資金対民間収支	*米国2月の貿易収支	*国庫短期証券(673回)入札(3ヶ月、44,000億円、4/6発行)
*3月のマネタリーベース	*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(23,000億円、4/6発行)

◆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