

Central Daily Market Report

2017年4月4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	2017年4月4日		2017年4月5日		2017年4月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		800		1,000	
財政	▲ 9,900		5,800		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 9,000		6,600		▲ 19,000	
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						
国債買入	11,400		4,100			
CP等買入			▲ 300			
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			700			
国債補完供給	▲ 3,000	2,800	3,000			
当預増減	2,200		14,100		▲ 19,000	
当座預金残高	3,460,900		3,475,000		3,456,000	
準備預金残高	3,092,800					
積み終了先	2,591,000					
超過準備	2,591,000					
非準備預金先	368,100					
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	99.95%	日数	64.52%		

●2017年4月4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1兆1,000億円減少の259兆8,000億円(当座預金残高見込みは346兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.075~▲0.07%、証券業態から▲0.07~▲0.05%、地銀業態から▲0.03~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。普通交付税の払いや税揚げといった資金需給イベントの動向を見極めたいとの思惑からか、昨日に引き続き調達意欲は弱く、朝方は▲0.075~▲0.02%の幅広いレンジでの出会い。一巡後もレート水準はあまり変わらず、▲0.075~▲0.03%のレンジの出会いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/5-4/6)は、▲0.055~▲0.045%程度のお合い。S/N(4/6-4/7)は、▲0.045~▲0.035%程度のお合いが見られた。S/Nは、短期3M物の発行要因から資金調達ニーズが厚く見られており、レート水準を若干上げての推移となった。SCでは、ロールオーバー中心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。アウトライト市場は新発3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.18%のお合いが見られる中、入札結果は按分落札利回▲0.1389%、平均落札利回▲0.1612%となった。年度末の担保需要が剥落したこと、今週に合計3本の入札が予定されていること、短国買入オペの動向が不透明なこと、等の要因から慎重姿勢が強まり、レート水準を大幅に切り上げる展開となった。セカンダリーは▲0.165~▲0.15%で散発的なお合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、償還総額200億円程度に対し発行案件は見られず、閑散なマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/4	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.054	0.060	▲ 0.010	18,810.25	▲ 172.98	110.68-69	110.47-48
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.049						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.003	▲ 0.020				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.100						
1M			0.001				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.163	▲ 0.149						
6M							▲ 0.175	▲ 0.195						
1Y							▲ 0.176	▲ 0.216						
									日付	3/28	3/29	3/30	3/31	4/3
									日銀当預残	3,415,900	3,414,100	3,432,000	3,428,200	3,458,700
									準備預金残	3,069,700	3,073,400	3,088,600	3,075,600	3,088,100
									マネタリーベース	4,459,200	4,457,900	4,476,800	4,473,300	4,502,400
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.046%	▲0.046%	▲0.060%	▲0.056%
									コール市場残高	96,656	95,212	94,778	49,854	85,907
									うち無担	77,138	75,824	75,325	41,200	65,924
									うちO/N	53,299	52,548	54,991	33,420	48,306
									うち有担	19,518	19,388	19,453	8,654	19,983

●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)
国庫短期証券	673	-	44,300	2017/4/6	2017/7/3	214,240.0	40,408.7	100.0335	▲0.1389%	65.1428%	100.0389	▲0.1612%	3,891.0
10年利付国債	346	0.10%	23,000	2017/4/6	2027/3/20	82,302.0	20,775.00	100.3200	0.0670%	57.3576%	100.3500	0.0640%	2,210.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	73142	2017/4/4	2017/4/5		2,915	2,915		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/4/6	2017/4/13	1.4	0	0				

●2017年4月5日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国3月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(674回)入札(6ヶ月、29,000億円、4/10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