

Central Daily Market Report

2017年4月6日(木)

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6日		2017年4月7日		2017年4月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		200		2,000	
財政	▲ 17,700		4,900		▲ 37,000	
資金過不足	▲ 17,200		5,100		▲ 35,000	
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					1,600	▲ 3,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 300	3,500	
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	100		900			
国債補完供給	▲ 1,800	1,900		1,800		
当預増減	▲ 17,100		19,000		▲ 33,800	
当座預金残高	3,456,100		3,475,100		3,441,300	
準備預金残高	3,102,100					
積み終了先	2,603,100				4月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,603,100				積数	800
非準備預金先	354,000				1日平均	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	99.96%	日数	70.97%		

●2017年4月6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5,000億円減少の259兆6,000億円(当座預金残高見込みは345兆8,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.06~▲0.04%、証券業態から▲0.06~▲0.05%、地銀業態から▲0.04~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。前日の加重平均レート上昇を受けて朝方からやや高めめのビッドが入り、朝方は▲0.06~▲0.02%のレンジでの出会い。一巡後は▲0.07~▲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(4/7-4/10)は、▲0.035~▲0.02%程度のお合い。S/N(4/10-4/11)は、▲0.03~▲0.025%程度のお合いが見られた。S/Nは短国の発行要因からレートを一段と上げる動きとなった。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などに引き続き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▲0.15%のお合いが少額みられる中、入札結果は按分落札利回▲0.1303%、平均落札利回▲0.1431%と引き続き慎重姿勢を反映した結果となった。セカンダリー市場では3Mで▲0.145~▲0.135%、6Mで▲0.159~▲0.155%のお合いがみられた。

<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・ノンバンク業態から大型の発行案件がみられ、償還総額700億円に対し発行総額1,200億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

2017/4/6	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	▲ 0.042				-	▲ 0.044	0.056	▲ 0.004	18,597.06	▲ 264.21	110.39-41	110.51-53
T/N			0.000				-	▲ 0.031						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.013	▲ 0.015				-	▲ 0.071						
2W							-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.094						
1M			0.005				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.140	▲ 0.142						
6M							▲ 0.161	▲ 0.192						
1Y							▲ 0.154	▲ 0.212						
									日付	3/30	3/31	4/3	4/4	4/5
									日銀当預残	3,432,000	3,428,200	3,458,700	3,460,900	3,473,200
									準備預金残	3,088,600	3,075,600	3,088,100	3,092,100	3,100,900
									マネタリーベース	4,476,800	4,473,300	4,502,400	4,503,800	4,515,100
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.060%	▲0.056%	▲0.056%	▲0.052%
									コール市場残高	94,778	49,854	85,907	87,836	90,755
									うち無担	75,325	41,200	65,924	68,415	71,497
									うちO/N	54,991	33,420	48,306	49,560	51,457
									うち有担	19,453	8,654	19,983	19,421	19,258

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	675	-	43,800	2017/4/10	2017/7/10	176,661.0	39,790.4	100.0325	▲0.1303%	53.7482%	100.0357	▲0.1431%	4,009.0
流動性供給	235	-	5,000	2017/4/10	-	14,008.0	4,991.0		0.0060%	12.6182%		0.0020%	
交付税特会	-	-	10,500	2017/4/14	2017/10/12	151,678.0	10,500.04		0.0000%	6.9577%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/4/10	2017/4/24		1,600	1,600				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,531	2017/4/6	2017/4/7		1,770	1,770		▲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	2017/4/6	2017/4/7		8	8		▲0.600	▲0.600	

●2017年4月7日の予定

*2月の毎月勤労統計調査速報	*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国2月の消費者信用残高
*2月の景気動向指数速報		*米国3月の雇用統計

◆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