

Central Daily Market Report

2017年4月7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	2017年4月7日		2017年4月10日		2017年4月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		1,400		3,000	
財政	5,800		▲ 34,400		1,000	
資金過不足	6,100		▲ 33,000		4,000	
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					20,000	
国債買入	11,500				9,600	
CP等買入		▲ 300	3,500	▲ 100		
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	900		400			
国債補完供給	▲ 2,000	1,800		2,000		
当預増減	18,000		▲ 29,500		33,600	
当座預金残高	3,474,100		3,444,600		3,478,200	
準備預金残高	3,120,200					
積み終了先	2,622,200				4月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,622,200				積数	400
非準備預金先	353,900				1日平均	100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						2,262,700
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	80.65%		

●2017年4月7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3兆2,000億円増加の262兆8,000億円(当座預金残高見込みは347兆5,000億円)。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▲0.05~▲0.03%、地銀業態から▲0.04~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。参加者の顔ぶれに変化は無いものの、週末要因の影響もあり全体的に調達意欲が高く、朝方は▲0.04~▲0.02%のレンジでの出会い。一巡後は▲0.06~▲0.04%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(4/10-4/11)は、▲0.03~▲0.02%程度のお合い。S/N(4/11-4/12)は、▲0.04~▲0.03%程度で出会いが見られた。S/Nは短国・国債買入オペがオフアされたものの、引き続き資金調達ニーズが厚く見られ、レート水準にはほとんど変わりがなかった。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レポレートが上昇していることもあってか、短国買入オペが2兆円オフアされた。結果は按分落札利回較差+0.016%、平均落札利回較差+0.018%と、既にレート水準が上昇していることもあり、応札額が6兆円強と膨らんだにしては小甘い程度の結果となった。セカンダリー市場では3Mで▲0.145~▲0.14%、6Mで▲0.16%の出会いがみられた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、石油・電機業態から大型の発行案件がみられたものの、案件は少なく、償還総額800億円に対し発行総額500億円と償還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

2017/4/7	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.034	0.045	▲ 0.011	18,664.63	67.57	110.88-90	110.60-62
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.020						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.002	▲ 0.018				-	▲ 0.069						
2W							-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.095						
1M			0.005				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.140	▲ 0.139						
6M							▲ 0.155	▲ 0.193						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.212						
									日付	3/31	4/3	4/4	4/5	4/6
									日銀当預残	3,428,200	3,458,700	3,460,900	3,473,200	3,456,100
									準備預金残	3,075,600	3,088,100	3,092,100	3,100,900	3,102,100
									マネタリーベース	4,473,300	4,502,400	4,503,800	4,515,100	4,497,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.060%	▲ 0.056%	▲ 0.056%	▲ 0.052%	▲ 0.042%
									コール市場残高	49,854	85,907	87,836	90,755	97,469
									うち無担	41,200	65,924	68,415	71,497	77,877
									うちO/N	33,420	48,306	49,560	51,457	56,309
									うち有担	8,654	19,983	19,421	19,258	19,592

●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
国庫短期証券買入	20,000	2017/4/11			61,300	20,000	0.016		0.018	28.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/4/11			10,670	2,806	▲0.017		▲0.015	42.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2017/4/11			10,328	3,804	▲0.018		▲0.013	26.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/4/11			5,699	2,003	▲0.010		▲0.007	30.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/4/11			3,762	1,002	▲0.017		▲0.013	61.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	42,797	2017/4/7	2017/4/10		1,896	1,896		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)	10,000	2017/4/7	2017/4/10		43	43		▲0.500	▲0.500	

●2017年4月10日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*2月の国際収支 *3月の景気ウォッチャー調査	*3月のFRB労働市場情勢指数
--------------------------	----------------------------	-----------------

◆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