# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貨金需和								
¥/4 /* F	2017年4	4月12日	2017年4	4月13日	2017年4月14日			
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想			
銀行券		600		▲ 800		0		
財政		2, 500		2, 100		77, 000		
資金過不足		3, 100		1, 300		77, 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					10, 800			
CP等買入		▲ 200		▲ 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								
ETF買入								
国債補完供給	<b>▲</b> 1,900	1, 800		1, 900				
当預増減		2, 800		2, 900		87, 800		
当 <u>座預金残高</u>		478, 100	3,	481, 000	3, 568, 800			
準 <u>備預金残高</u>		116, 100	١.					
積み終了先		623, 300			降の残り所要積立額			
超過準備		623, 200		積数				
非準備預金先	,	362, 000		1日平均	0			
積み期間(3/16~	$4/15) \sigma_{x}$	)所要準(	備額		2, 262, 700			
準備預金進捗率	実績		100.00%	日数		90.32%		

# ●2017年4月12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、前日比増減なしの262兆2,000億円 (当座預金残高見込みは347兆9,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信 **託業態などから▲0.05~▲0.04%、証券業態から▲0.04~▲0.035%、地銀** 業態から▲0.04~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。昨日までと同様、▲ 0.05%近辺ではビッドが底堅く、朝方は▲0.045~▲0.02%のレンジでの出合 い。一巡後は▲0.05~▲0.03%のレンジで出合いが見られた。ターム物は閑 散な地合いだった。

### 〈レポ市場〉

GC T/N(4/13-4/14)は、▲0.025~▲0.015%程度の出合い。S/N(4/14-4/17)は、▲0.075~▲0.06%程度で出合いが見られた。S/Nは積み最終か ら新積み期をまたぐ取引となり、資金調達サイドが様子見姿勢を強め、レー トは低下傾向で推移した。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、5Y130~131、10Y334~346、20Y160、30Y50 ~54などに引き続きビッドの出入りが多く見られた。

現先S/N物は低下した。アウトライト市場は、店頭の買いからか、3M物で▲ 0.135~▲0.13%での出合いが見られた。

### 〈CP市場〉

現先レートは、低位横ばい圏での推移だった。CP発行市場は、五・十日に係 る発行となるため、ノンバンク業態等から大型発行があり、発行総額は1,400 億円程度となった。発行レートに大きな変動は見られず、引き続き0%近辺で の決着となった。

# ●短期金融市場関連指標

2017/4/12		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
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計值	平均値	直近値	前日比	15₽	寺時点	前日比
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.036				_	▲ 0.024	0.015	▲ 0.020	18,5	552.61	195.2
T/N			▲ 0.015				_	▲ 0.019	日付	4/	5	4/6	4/7
S/N							-	-	日銀当預残	3,473	-+	3,456,100	-
1W							_	▲ 0.069	準備預金残	3,100	,900	3,102,100	3,120,
2W	▲ 0.023	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.081	マネタリーベー	-ス 4,515	,100	4,497,600	4,515,
3W							-	▲ 0.094	無担O/N加重	平均 ▲0.0	052%	▲0.042%	▲0.0
1M							_	▲ 0.101	コール市場残る	高 90	,755	97,469	94,
3M							▲ 0.134	▲ 0.133	うち無担	71	,497	77,877	75,
6M							▲ 0.155	▲ 0.187	うち	50/N 51	,457	56,309	52,
1Y							▲ 0.149	▲ 0.211	うち有担	19	,258	19,592	19,

JGB新発10年頃					口栓平	12]/	休恤	トル/円				
直記	丘値	前	日比 1		15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)		
0.0	)15	<b>A</b> (	0.020 18		3,552.61 ▲		▲ 195.26		109.55-57	109.66-68		
日付			4/5	5	4/6		4/7		4/10	4/11		
日銀当	日銀当預残		3,473,	200	3,456,100		3,474,100		3,443,200	3,475,300		
準備預	準備預金残		3,100,900		3,102,100		3,120,200		3,090,800	3,108,900		
マネタ	リーベ	ース	4,515,100		4,497,600		4,515,200		4,482,900	4,513,900		
無担O	/N加 <u>1</u>	重平均	▲0.052%		▲0.042%		▲0.035%		▲0.037%	▲0.037%		
コール	コール市場残高		90,755		97,469		94,941		84,806	83,029		
	うち無担		71,497		77,877		75,233		64,412	62,919		
	-	550/N	51,457		56,3	09	52,958		42,196	40,087		
	うち有担		19,	258	19,592		19,708		20,394	20,110		

# ●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 I 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年超3年以下)	2,800	2017/4/14			11,472	2,808	▲0.008		▲0.007	65.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2017/4/14			13,994	3,507	▲0.009		▲0.008	98.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/4/14			18,499	4,508	▲0.013		▲0.011	53.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,801	2017/4/12	2017/4/13		1,811	1,811		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2017/4/12	2017/4/13		44	44		▲ 0.500	▲0.500	

# ●2017年4月13日の予定

- \*3月のマネーストック
- \*3月の企業物価指数
- \*米国3月の生産者物価指数
- \*国庫短期証券(676回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/17発行)
- \*30年利付国債入札 (8,000億円、4/17発行)
- \*交付税特別会計借入 (10,500億円、4/21借入)
- ◆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。
- ◆本資料は何ら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論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