

Central Daily Market Report

2017年4月13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13日		2017年4月14日		2017年4月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,200		2,000	
財政	2,200		80,300		▲ 23,000	
資金過不足	1,400		79,100		▲ 21,000	
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					2,700	▲ 3,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,000			
CP等買入		▲ 300		▲ 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			500			
国債補完供給	▲ 2,100	1,900		2,100		
当預増減	900		92,400		▲ 21,300	
当座預金残高	3,479,000		3,571,400		3,550,100	
準備預金残高	3,110,800					
積み終了先	2,616,300					
超過準備	2,616,200					
非準備預金先	368,200					
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	100.00%	日数	93.55%		

●2017年4月13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1,000億円増加の262兆3,000億円(当座預金残高見込みは348兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.05~▲0.035%、証券業態から▲0.035%近辺、地銀業態から▲0.04~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。朝方は▲0.045~▲0.02%のレンジでの出会い。一巡後は▲0.05~▲0.03%のレンジで出会いが見られた。ターム物は閑散な地合いだった。本日の共通担保資金供給オペは2W物8,000億円のオファーに対し、応札額2,650億円(期落ち額2,980億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(4/14-4/17)は、▲0.06~▲0.04%程度の出合い。S/N(4/17-4/18)は、▲0.085~▲0.07%程度で出会いが見られた。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が薄く、レートは低下しやすい状況となっている。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。

<短国市場>

現先S/N物は小幅低下した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.135~▲0.13%での出会いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1213%、按分落札利回▲0.107%と軟調な相場を反映した弱めの結果となった。セカンダリー市場では、▲0.11~▲0.105%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは、低位横ばいで推移した。CP発行市場は、五・十日に係る後倒し発行があったため、償還総額2,000億円程度に対して、発行総額2,500億円程度と発行がやや膨らんだ。石油、不動産業態等からは、大型発行も実施された。発行レートは、引き続き0%近辺での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/13	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.026	0.020	0.005	18,426.84	▲ 125.77	108.88-90	109.01-03
T/N	▲ 0.035	▲ 0.005	▲ 0.026				-	▲ 0.044						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.078						
2W			▲ 0.027				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.109	▲ 0.130						
6M							▲ 0.155	▲ 0.187						
1Y							▲ 0.146	▲ 0.211						
									日付	4/6	4/7	4/10	4/11	4/12
									日銀当預残	3,456,100	3,474,100	3,443,200	3,475,300	3,478,100
									準備預金残	3,102,100	3,120,200	3,090,800	3,108,900	3,116,100
									マネタリーベース	4,497,600	4,515,200	4,482,900	4,513,900	4,516,100
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.035%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.036%
									コール市場残高	97,469	94,941	84,806	83,029	84,968
									うち無担	77,877	75,233	64,412	62,919	65,240
									うちO/N	56,309	52,958	42,196	40,087	42,270
									うち有担	19,592	19,708	20,394	20,110	19,728

●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	676	-	44,100	2017/4/17	2017/7/18	174,120.0	40,266.6	100.0270	▲0.1070%	46.1563%	100.0306	▲0.1213%	3,833.0
30年利付国債	54	0.80%	8,000	2017/4/17	2047/3/20	22,307.0	7,234.0	100.0500	0.7970%	98.5832%	100.1200	0.7950%	754.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/4/21	2017/10/19	160,734.0	10,500.01		0.0000%	6.5638%		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>	8000	2017/4/17	2017/5/1		2,650	2,650				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	93,176	2017/4/13	2017/4/14		2,103	2,103		▲0.500	▲0.500	

●2017年4月14日の予定

*2月の特定サービス産業動態統計速報
*2月の石油等消費動態統計

*米国2月の企業在庫
*米国3月の消費者物価指数
*米国3月の小売売上高

*米国4月のミシガン大学、消費者信頼感指数速報
*EURO、London祝日(Good Friday)

◆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