

Central Daily Market Report

2017年4月14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14日		2017年4月17日		2017年4月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		600		1,000	
財政	80,800		▲ 20,000		3,000	
資金過不足	79,600		▲ 19,400		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			2,700	▲ 3,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					15,000	
国債買入	11,000				9,300	
CP等買入		▲ 300		▲ 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				▲ 100		
E T F買入	500		300			
国債補完供給	▲ 3,500	2,100		3,500		
当預増減	89,400		▲ 16,500		28,300	
当座預金残高	3,568,400		3,551,900		3,580,200	
準備預金残高	3,191,600					
積み終了先	2,680,900				4月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,680,900				積数	345,900
非準備預金先	376,800				1日平均	11,900
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						2,220,900
準備預金進捗率	実績	84.43%	日数	3.33%		

●2017年4月14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6兆3,000億円増加の268兆6,000億円(当座預金残高見込みは357兆1,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.07~▲0.065%、証券業態から▲0.065~▲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。週末に掛かり、実質的な積み最終日と積みの初日が重なったことや、年金定時払いによる資金余剰の影響を受け、昨日対比でレートが低下した。朝方は▲0.07~▲0.02%の幅広いレンジで出合いが見られた。一巡後は▲0.075~▲0.065%の出合いが中心となった。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(4/17-4/18)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(4/18-4/19)は、▲0.11~▲0.10%程度で出合いが見られた。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、ロールオーバーを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物は低下した。アウトライト市場は、短国買入オペが市場予想より多目の15,000億円で実施された。応札額が5兆1,826億円と多く、平均利回較差+0.010%、按分利回較差+0.005%と軟調なマーケットを反映した小甘い結果となった。オペ後は、3M物で▲0.105%での出合いが見られた。

<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、商社業態から大型発行案件が実施されたものの、発行総額は少なく、閑散とした相場であった。発行レートは、引き続き0%近辺となった。本日は、CP等買入オペが前回と同額の3,500億円で実施された。前回のオペの結果(平均▲0.006%、全取▲0.10%)を受けてか、平均落札レート▲0.009%、按分落札レート▲0.029%と、平均は低下、按分は上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/14	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	▲ 0.047				-	▲ 0.059	0.010	▲ 0.010	18,335.63	▲ 91.21	109.09-13	108.92-94
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.028	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.106						
1M	▲ 0.030	▲ 0.009	▲ 0.027				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.108	▲ 0.129						
6M							▲ 0.148	▲ 0.186						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.211						
									日付	4/7	4/10	4/11	4/12	4/13
									日銀当預残	3,474,100	3,443,200	3,475,300	3,478,100	3,479,000
									準備預金残	3,120,200	3,090,800	3,108,900	3,116,100	3,110,800
									マネタリーベース	4,515,200	4,482,900	4,513,900	4,516,100	4,517,900
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.036%	▲0.034%
									コール市場残高	94,941	84,806	83,029	84,968	87,796
									うち無担	75,233	64,412	62,919	65,240	68,606
									うちO/N	52,958	42,196	40,087	42,270	45,901
									うち有担	19,708	20,394	20,110	19,728	19,190

●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)	落札最低額	落札最高利回	案分率	落札平均価格	落札平均利回	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	15,000	2017/4/18			51,826	15,003	0.005		0.010	81.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/4/18			12,927	2,801	0.004		0.006	38.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2017/4/18			13,327	3,507	▲0.002		▲0.001	62.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/4/18			6,232	2,005	0.000		0.001	50.4
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/4/18			3,284	1,005	▲0.017		▲0.015	57.7
CP等買入	3,500	2017/4/19			9,372	3,498	▲0.029		▲0.009	54.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,679	2017/4/14	2017/4/17		3,406	3,406		▲0.500	▲0.500	

●2017年4月17日の予定

*黒田日銀総裁、第92回信託大会にて講演 *EURO、London祝日(Easter Monday)

◆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