

Central Daily Market Report

2017年4月17日(月)
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17日 | | 2017年4月18日 | | 2017年4月19日 | |
|-----------------------|------------|---------|-----------------|-------|------------|-------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 700 | ▲ 100 | | | | 0 |
| 財政 | ▲ 19,400 | | 1,700 | | | 5,000 |
| 資金過不足 | ▲ 18,700 | | 1,600 | | | 5,000 |
| 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 | | | 10,000 | | 5,500 | |
| CP等買入 | | ▲ 500 | | ▲ 100 | 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 | | ▲ 100 | | ▲ 300 | | |
| E T F買入 | 300 | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 9,000 | 3,500 | | 9,000 | | |
| 当預増減 | ▲ 24,800 | | 35,200 | | 14,000 | |
| 当座預金残高 | 3,543,600 | | 3,578,800 | | 3,592,800 | |
| 準備預金残高 | 3,172,200 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,548,100 | | 4月18日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 2,433,500 | | 積数 | | 117,400 | |
| 非準備預金先 | 371,400 | | 1日平均 | | 4,200 | |
| 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 | 94.71% | 日数 | 6.67% | | |

●2017年4月17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1兆4,000億円減の267兆円2,000億円(当座預金残高は355兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.08~▲0.065%、証券業態から▲0.065~▲0.035%、地銀業態から▲0.04~▲0.02%の調達希望で立ち上がり、先週末に年金の定時払いがあったことや、積みの実質的な初日ということもあって、調達側は慎重姿勢を見せていた。一巡後は▲0.07~▲0.06%前後での調達が見られる中、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件中心の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/18-4/19)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(4/19-4/20)は、▲0.105~▲0.10%程度で出合いが見られた。前日に続いて調達サイドが薄く、▲0.10%近辺では運用希望が残る展開となった。SC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、335、336、341、343、20y160、30y51、52などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライ市場は3M▲0.11%の出合いが見られた程度で、全般的に動意に乏しく、閑散だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散であった。

●短期金融市場関連指標

| 2017/4/17 | 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 | ▲ 0.070 | 0.001 | ▲ 0.054 | | | | - | ▲ 0.082 | 0.000 | ▲ 0.010 | 18,355.26 | 19.63 | 108.31-33 | 108.32-33 |
| T/N | ▲ 0.070 | ▲ 0.015 | ▲ 0.060 | | | | - | ▲ 0.094 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.033 | 0.230 | ▲ 0.018 | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.030 | ▲ 0.025 | ▲ 0.027 | | | | - | ▲ 0.105 | | | | | | |
| 3W | | | ▲ 0.013 | | | | - | ▲ 0.110 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.020 | | | | - | ▲ 0.114 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.110 | ▲ 0.130 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.146 | ▲ 0.186 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.140 | ▲ 0.211 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 4/10 | 4/11 | 4/12 | 4/13 | 4/14 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,443,200 | 3,475,300 | 3,478,100 | 3,479,000 | 3,568,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,090,800 | 3,108,900 | 3,116,100 | 3,110,800 | 3,191,600 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,482,900 | 4,513,900 | 4,516,100 | 4,517,900 | 4,608,400 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.037% | ▲0.037% | ▲0.036% | ▲0.034% | ▲0.047% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 84,806 | 83,029 | 84,968 | 87,796 | 90,109 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 64,412 | 62,919 | 65,240 | 68,606 | 70,718 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 42,196 | 40,087 | 42,270 | 45,901 | 49,957 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 20,394 | 20,110 | 19,728 | 19,190 | 19,391 |

●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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,500 | 2017/4/19 | | | 14,503 | 4,510 | ▲0.005 | | ▲0.004 | 60.7 |
| 国債買入(変動利付債) | 1,000 | 2017/4/19 | | | 4,354 | 1,001 | ▲0.220 | | ▲0.322 | 59.2 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 103,785 | 2017/4/17 | 2017/4/18 | | 7,906 | 7,906 | | ▲0.500 | ▲0.501 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 24,476 | 2017/4/17 | 2017/4/18 | | 865 | 865 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

| 種類 | スタート日 | エンド日 | 貸付利率 | 貸付予定総額(億円) | |
|---------------|-------|-----------|-----------|------------|-------|
| 被災地金融支援オペ | 第72回 | 2017/4/21 | 2018/4/20 | 0 | 1,068 |
| 被災地金融支援オペ(熊本) | 第11回 | 2017/4/21 | 2018/4/20 | 0 | 3 |

●2017年4月18日の予定

| | | |
|-------------------|----------------------|-------------------|
| *米国3月の住宅着工件数 | *国庫短期証券(677回)入札 | *5年利付国債入札 |
| *米国3月の鉱工業生産・設備稼働率 | (1年、23,000億円、4/20発行) | (22,000億円、4/20発行) |

◆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