

Central Daily Market Report

2017年4月18日(火)

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18日		2017年4月19日		2017年4月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 600		▲ 2,000	
財政	2,100		3,800		▲ 33,000	
資金過不足	2,000		3,200		▲ 35,000	
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	15,000					
国債買入	10,000		5,600			
CP等買入		▲ 100	3,500	▲ 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		▲ 300				
E T F買入			500			
国債補完供給	▲ 9,400	9,000	9,400			
当預増減	26,200		21,900		▲ 35,000	
当座預金残高	3,569,800		3,591,700		3,556,700	
準備預金残高	3,199,200					
積み終了先	2,661,500				4月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,616,400				積数	44,300
非準備預金先	370,600				1日平均	1,600
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	98.01%	日数	10.00%		

●2017年4月18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2兆9,000億円増の270兆円1,000億円(当座預金残高は357兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.07~▲0.06%、証券業態から▲0.07~▲0.04%、地銀業態から▲0.04~▲0.02%の調達で始まった。昨日同様に、一巡後は▲0.07%近辺での出会いが散見された。ターム物は、ショートターム物の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/19-4/20)、S/N(4/20-4/21)共に、▲0.10~▲0.095%程度で出会いが見られた。4/20は短国1Y物の発行日にあたったが、引き続き資金調達サイドの動きは鈍く、レートはほぼ横ばい圏にとどまった。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5y121、123、130、131、10y336、341、343、20y160、30y36、51、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。アウトライト市場は1Y物の入札が実施された。結果は平均落札利回▲0.1677%、按分落札利回▲0.1537%と事前予想より強めの決着となった。セカンダリーは▲0.195~▲0.175%の出会いと強含んだ。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は20日発行となり石油、機械業態等からまとまった発行が見られ、総額2,300億円程度に膨らんだ。発行レートは期間を問わず、積極的な買いが見られ0%近辺での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総計値	東京 レポレート 平均値	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	0.010	▲ 0.053				-	▲ 0.087	0.010	0.010	18,418.59	63.33	109.13-14	108.86-87
T/N	▲ 0.070	▲ 0.005	▲ 0.057				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.028				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.030				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.124	▲ 0.131						
6M							▲ 0.145	▲ 0.186						
1Y							▲ 0.188	▲ 0.211						
									日付	4/11	4/12	4/13	4/14	4/17
									日銀当預残	3,475,300	3,478,100	3,479,000	3,568,400	3,543,600
									準備預金残	3,108,900	3,116,100	3,110,800	3,191,600	3,172,200
									マネタリーベース	4,513,900	4,516,100	4,517,900	4,608,400	4,583,000
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.036%	▲0.034%	▲0.047%	▲0.054%
									コール市場残高	83,029	84,968	87,796	90,109	93,896
									うち無担	62,919	65,240	68,606	70,718	73,447
									うちO/N	40,087	42,270	45,901	49,957	50,657
									うち有担	20,110	19,728	19,190	19,391	20,449

●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)	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	677	-	23,000	2017/4/20	2018/4/20	121,318.0	20,957.8	100.1540	▲0.1537%	9.3081%	100.1680	▲0.1677%	2,042.0
5年利付国債	131	0.10%	22,000	2017/4/20	2022/3/20	65,587.0	19,967.00	101.2500	▲0.1520%	50.9655%	101.2900	▲0.1600%	2,023.0

●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
社債等買入	750	2017/4/24			3,560	751	▲0.009		0.000	35.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	73,446	2017/4/18	2017/4/19		9,207	9,207		▲0.600	▲0.693	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/4/18	2017/4/19		42	42		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/4/20	2017/4/27	1.41		0				

●2017年4月19日の予定

- *米国ベージュブック
- *ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値
- *交付税特別会計借入(10,500億円、4/28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お客様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