

Central Daily Market Report

2017年4月20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20日		2017年4月21日		2017年4月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 1,500		▲ 3,000	
財政	▲ 36,300		8,400		▲ 15,000	
資金過不足	▲ 38,400		6,900		▲ 18,000	
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					1,800	▲ 1,800
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		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			1,100	▲ 1,100		
社債等買入		▲ 100			800	
E T F買入	600					
国債補完供給	▲ 1,700	9,200		1,700		
当預増減	▲ 30,700		19,400		▲ 17,200	
当座預金残高	3,552,700		3,572,100		3,554,900	
準備預金残高	3,172,700					
積み終了先	2,661,100					
超過準備	2,656,200					
非準備預金先	380,000					
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	99.19%	日数	16.67%		

●2017年4月20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3兆2,000億円減の266兆9,000億円(当座預金残高は355兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.075~▲0.07%、証券業態から▲0.07~▲0.065%、地銀業態から▲0.04~▲0.02%の調達で始まった。全体的に調達意欲は薄く、取り急ぎ姿は見られなかった。一巡後は▲0.07%近辺での出合いが散見された。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/21-4/24)が▲0.10~▲0.095%程度、S/N(4/24-4/25)が▲0.095~▲0.09%程度の出合いだった。4/24は短期3M物の発行日にあたったが、レートの上昇は限定的だった。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5y123、126、130、10y334、336、343、30y50、51、52等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。本日は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.14%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1427%、按分落札利回▲0.1343%と事前予想通りの順調な結果となった。セカンダリーでは明日の短国買入オペを控えて、3M▲0.17%、1Y▲0.239%の出合いと、全般的に強含む展開となった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社、機械、小売業態等からまたまった発行が見られ、総額2,500億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/4/20	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	▲ 0.061				-	▲ 0.090	0.010	0.010	18,430.49	▲ 1.71	108.83-85	108.99-01
T/N	▲ 0.075	▲ 0.035	▲ 0.072				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.034				-	▲ 0.116						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.120						
3W			▲ 0.050				-	▲ 0.119						
1M							-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.155	▲ 0.130						
6M							▲ 0.145	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.209	▲ 0.211						
									日付	4/13	4/14	4/17	4/18	4/19
									日銀当預残	3,479,000	3,568,400	3,543,600	3,569,800	3,583,400
									準備預金残	3,110,800	3,191,600	3,172,200	3,199,200	3,196,600
									マネタリーベース	4,517,900	4,608,400	4,583,000	4,609,300	4,623,500
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.047%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.056%
									コール市場残高	87,796	90,109	93,896	95,499	91,720
									うち無担	68,606	70,718	73,447	74,959	72,166
									うちO/N	45,901	49,957	50,657	51,005	46,815
									うち有担	19,190	19,391	20,449	20,540	19,554

●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	678	-	43,900	2017/4/24	2017/7/24	156,053.0	39,756.5	100.0335	▲0.1343%	13.4260%	100.0356	▲0.1427%	4,143.0
20年利付国債	160	0.70%	10,000	2017/4/24	2037/3/20	36,658.0	9,036.00	102.4000	0.5650%	4.6352%	102.4700	0.5620%	956.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2017/4/24	2017/5/8		1,540	1,540				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	5,000	2017/4/24	2017/7/31		220	220				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,785	2017/4/20	2017/4/21		1,705	1,705		▲0.600	▲0.601	

●2017年4月21日の予定

*2月の第3次産業活動指数	*米国3月の中古住宅販売	*交付税特別会計借入(10,500億円、5/2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