

Central Daily Market Report

2017年4月21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21日		2017年4月24日		2017年4月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 1,000		▲ 3,000	
財政	6,200		▲ 29,800		14,000	
資金過不足	4,600		▲ 30,800		11,000	
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					10,000	
国債買入	11,000				3,700	
CP等買入		▲ 200		▲ 500		
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			800			
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 1,700	1,700		1,700		
当預増減	15,400		▲ 28,100		24,700	
当座預金残高	3,568,100		3,540,000		3,564,700	
準備預金残高	3,169,700					
積み終了先	2,661,500		4月24日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	2,660,000				8,600	
非準備預金先	398,400		1日平均		400	
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		99.61%		日数	
					26.67%	

●2017年4月21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8,000億円増の267兆7,000億円(当座預金残高は357兆2,000億円)。本日の無担O/Nの立ち上がりは、大手行を中心に▲0.08~▲0.075%、証券業態から▲0.075~▲0.07%、地銀業態から▲0.05~▲0.03%の調達で始まった。週末を挟む三日積みで進捗が大幅に進んでしまうことから調達意欲に乏しく、ギブン地合いの様相となった。一巡後は▲0.078%近辺での出合いが見られた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/24-4/25)が▲0.095~▲0.085%程度、S/N(4/25-4/26)が▲0.095~▲0.09%程度の出合いだった。短国買入オペアと輪番オペアが通知されたが、S/Nの取引に大きな影響は見られず、前日から横ばい圏のレート水準だった。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、10y336、343、30y52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の推移。短国買入オペアが1兆円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.002%、按分落札利回較差▲0.006%の落ち着いた結果となった。セカンダリーでは、3M▲0.17~▲0.1675%、6M▲0.17%、1Y▲0.21~▲0.20%の水準で出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は25日発行となり鉄鋼、自動車、化学業態等からまとまった発行が見られたものの、発行総額1,300億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/4/21	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.091	0.010	0.000	18,620.75	190.26	109.38-39	109.20-21
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.045				-	▲ 0.122						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.121						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.166	▲ 0.130						
6M							▲ 0.146	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.206	▲ 0.211						
									日付	4/14	4/17	4/18	4/19	4/20
									日銀当預残	3,568,400	3,543,600	3,569,800	3,583,400	3,552,700
									準備預金残	3,191,600	3,172,200	3,199,200	3,196,600	3,172,700
									マネタリーベース	4,608,400	4,583,000	4,609,300	4,623,500	4,594,900
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.054%	▲0.053%	▲0.056%	▲0.061%
									コール市場残高	90,109	93,896	95,499	91,720	96,744
									うち無担	70,718	73,447	74,959	72,166	76,590
									うちO/N	49,957	50,657	51,005	46,815	49,475
									うち有担	19,391	20,449	20,540	19,554	20,154

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/5/2	2017/11/2	155,908.0	10,500.08		0.0000%	6.7715%		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
国庫短期証券買入	10,000	2017/4/25			33,413	10,000	▲0.006		▲0.002	74.8
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/4/25			6,220	700	0.060		0.063	93.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/4/25			5,385	2,010	0.002		0.003	79.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/4/25			2,711	1,006	0.003		0.004	52.6
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	30,457	2017/4/21	2017/4/24		1,684	1,684		▲0.600	▲0.601	

●2017年4月24日の予定

*2月の景気動向指数改訂状況

◆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