

Central Daily Market Report

2017年4月24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24日		2017年4月25日		2017年4月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 1,800		▲ 5,000	
財政	▲ 31,300		4,600		2,000	
資金過不足	▲ 32,400		2,800		▲ 3,000	
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			4,000		10,800	
CP等買入		▲ 500		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800			▲ 200		
E T F買入	700		200			
国債補充供給	▲ 1,900	1,700		1,900		
当預増減	▲ 31,600		18,300		7,800	
当座預金残高	3,536,500		3,554,800		3,562,600	
準備預金残高	3,168,400					
積み終了先	2,661,800		4月25日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	2,661,700				7,600	
非準備預金先	368,100		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	99.66%	日数	30.00%		

●2017年4月24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1兆8,000億円減の265兆9,000億円(当座預金残高は354兆円)。本日の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.085~▲0.08%、証券業態から▲0.08~▲0.07%、地銀業態から▲0.085~▲0.05%の調達で始まった。先週より一層調達は慎重姿勢となり、取り急ぐ姿は全く見られなかった。一巡後は▲0.085~▲0.075%近辺での出会いが散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/25-4/26)が▲0.095~▲0.09%程度、S/N(4/26-4/27)が▲0.100~▲0.095%程度の出合いだった。S/Nは国債買入オベが通知されたこともあり、全体的に資金調達ニーズが弱く、レートは低下した。SCI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。アウトライト市場は、動意なく閑散としていた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は、商社、ノンバンク業態からまとまった発行が見られ、1,200億円程度の規模となった。発行レートに変動はなく、0%近辺での発行が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/24	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	0.010	▲ 0.070				-	▲ 0.090	0.020	0.010	18,875.88	255.13	110.01-03	110.07-08
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.041				-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.121						
3W							-	▲ 0.120						
1M			0.000				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.167	▲ 0.132						
6M							▲ 0.147	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.211						
									日付	4/17	4/18	4/19	4/20	4/21
									日銀当預残	3,543,600	3,569,800	3,583,400	3,552,700	3,568,100
									準備預金残	3,172,200	3,199,200	3,196,600	3,172,700	3,169,700
									マネタリーベース	4,583,000	4,609,300	4,623,500	4,594,900	4,611,900
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.053%	▲0.056%	▲0.061%	▲0.066%
									コール市場残高	93,896	95,499	91,720	96,744	95,810
									うち無担	73,447	74,959	72,166	76,590	75,529
									うちO/N	50,657	51,005	46,815	49,475	45,045
									うち有担	20,449	20,540	19,554	20,154	20,281

●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)	募入最低値	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1年超3年以下)	2,800	2017/4/26			15,138	2,807	0.008		0.010	5.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2017/4/26			11,132	3,205	0.015		0.016	46.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/4/26			15,083	4,503	0.007		0.007	80.1
国債買入(物価連動債)	250	2017/4/26			1,682	250		▲0.300	▲0.300	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	54,522	2017/4/24	2017/4/25		1,571	1,571		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/4/24	2017/4/25		250	250		▲0.600	▲0.600	

●2017年4月25日の予定

*3月の企業向けサービス価格指数	*米国2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,500億円、4/27発行)
	*米国3月の新築一戸建て販売件数	
	*米国4月のCB消費者信頼感指数	

◆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