

Central Daily Market Report

2017年4月25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25日		2017年4月26日		2017年4月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,900		▲ 2,700		▲ 5,000	
財政	6,000		4,000		▲ 1,000	
資金過不足	4,100		1,300		▲ 6,000	
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	10,000					
国債買入	4,000		10,900			
CP等買入		▲ 400		▲ 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		▲ 200				
E T F買入	200		800			
国債補完供給	▲ 2,500	1,900		2,500		
当預増減	17,100		15,200		▲ 6,000	
当座預金残高	3,553,600		3,568,800		3,562,800	
準備預金残高	3,174,300					
積み終了先	2,666,500				4月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,666,200				積数 6,900	
非準備預金先	379,300				1日平均 300	
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	99.69%	日数	33.33%		

●2017年4月25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1兆円増の266兆9,000億円(当座預金残高は355兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.086~▲0.085%、証券業態から▲0.085~▲0.075%、地銀業態から▲0.086~▲0.07%の調達で立ち上がり、資金調達意欲は引き続き乏しく、▲0.085%前後の低位な出合いで一日終始した。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/26-4/27)が▲0.105~▲0.095%程度、S/N(4/27-4/28)が▲0.105~▲0.100%程度の出合いだった。S/Nは引き続き資金調達ニーズが薄く、▲0.100%程度の資金運用ニーズがしっかり見られた。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。アウトライト市場は、1Y▲0.205%、3M▲0.17~▲0.165%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は、月末を控えて食料品、鉄鋼、不動産業態から大型の発行案件が見られ、総額2,600億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。CP等買入オペは3,500億円でオファーされ、平均落札レート▲0.012%、按分落札レート▲0.019%となった。前回(平均▲0.009%、按分▲0.029%)より平均は低下、按分は上昇した。

●短期金融市場関連指標

2017/4/25	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	▲0.086	0.001	▲0.074				-	▲0.094	0.015	▲0.005	19,079.33	203.45	109.62-64	110.30-31
T/N			▲0.030				-	▲0.097						
S/N							-	-						
1W	▲0.050	▲0.040	▲0.045				-	▲0.121						
2W			▲0.045				-	▲0.121						
3W	▲0.045	0.001	▲0.030				-	▲0.121						
1M							-	▲0.121						
3M							▲0.168	▲0.131						
6M							▲0.148	▲0.182						
1Y							▲0.199	▲0.211						
									日付	4/18	4/19	4/20	4/21	4/24
									日銀当預残	3,569,800	3,583,400	3,552,700	3,568,100	3,536,500
									準備預金残	3,199,200	3,196,600	3,172,700	3,169,700	3,168,400
									マネタリーベース	4,609,300	4,623,500	4,594,900	4,611,900	4,581,400
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.056%	▲0.061%	▲0.066%	▲0.070%
									コール市場残高	95,499	91,720	96,744	95,810	89,419
									うち無担	74,959	72,166	76,590	75,529	69,975
									うちO/N	51,005	46,815	49,475	45,045	41,050
									うち有担	20,540	19,554	20,154	20,281	19,444

●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)
流動性供給	236	-	5,500	2017/4/27	-	18,746.0	5,483.00		▲0.0120%	64.3606%		▲0.0130%	

●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
CP等買入	3,500	2017/4/28			8,396	3,495	▲0.019		▲0.012	90.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	25,064	2017/4/25	2017/4/26		2,414	2,414		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/4/27	2017/5/11	1.36	0	0				

●2017年4月26日の予定

*日銀政策委員会金融政策決定会合(1日目、27日まで)
*国庫短期証券(679回)入札
(3ヶ月、44,000億円、5/1発行)

*交付税特別会計借入
(10,500億円、5/11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