

Central Daily Market Report

2017年4月26日(水)

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26日		2017年4月27日		2017年4月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,800		▲ 3,200		▲ 5,900	
財政	3,600		▲ 7,300		300	
資金過不足	800		▲ 10,500		▲ 5,600	
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						
国債買入	10,900				7,500	
CP等買入		▲ 300		▲ 300	3,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	800		700			
国債補完供給	▲ 2,400	2,500	2,400			
当預増減	12,300		▲ 7,800		5,400	
当座預金残高	3,565,900		3,558,100		3,563,500	
準備預金残高	3,180,300					
積み終了先	2,674,300		4月27日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	2,674,300				6,200	
非準備預金先	385,600		1日平均		300	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					2,220,700	
準備預金進捗率	実績	99.72%	日数	36.67%		

●2017年4月26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5,000億円増の267兆4,000億円(当座預金残高は356兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.086%、証券業態から▲0.086~▲0.07%、地銀業態から▲0.086~▲0.065%の調達で立ち上がり。昨日同様に調達側が慎重姿勢を見せており、取り急ぎ姿は見られなかった。一巡後は▲0.08~▲0.07%近辺での出合いが散見された。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/27-4/28)が▲0.105~▲0.100%程度、S/N(4/28-5/1)が▲0.150~▲0.100%程度の出合いだった。S/Nは月末で資金調達を控えた先が多く、玉確保の買いが先行し▲0.100%を下回る出合いとなった。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。本日は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.15~▲0.145%の出合いとなる中、平均落札利回▲0.1475%、按分落札利回▲0.1383%の順調な結果となった。その後のセカンダリーでは▲0.145~▲0.136%で出合いが見られた。また、6M▲0.175%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、二営業日後が月末発行にあたるため、様々な業態からの発行が見られ、6,500億円程の規模に膨らんだ。商社・石油・不動産業態等からは大型の発行案件が実施された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/26	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	▲ 0.075				-	▲ 0.095	0.016	0.001	19,289.43	210.10	111.07-09	111.23-24
T/N	▲ 0.085	▲ 0.030	▲ 0.071				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.042				-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.036				-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.125						
1M	▲ 0.080	▲ 0.060	▲ 0.072				-	▲ 0.125						
3M			0.100				▲ 0.138	▲ 0.131						
6M							▲ 0.149	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.211						
									日付	4/19	4/20	4/21	4/24	4/25
									日銀当預残	3,583,400	3,552,700	3,568,100	3,536,500	3,553,600
									準備預金残	3,196,600	3,172,700	3,169,700	3,168,400	3,174,300
									マネタリーベース	4,623,500	4,594,900	4,611,900	4,581,400	4,600,400
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.061%	▲0.066%	▲0.070%	▲0.074%
									コール市場残高	91,720	96,744	95,810	89,419	86,789
									うち無担	72,166	76,590	75,529	69,975	66,654
									うちO/N	46,815	49,475	45,045	41,050	37,517
									うち有担	19,554	20,154	20,281	19,444	20,135

●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	679	-	43,900	2017/5/1	2017/7/31	131,073.0	39,805.6	100.0345	▲0.1383%	22.4489%	100.0368	▲0.1475%	4,094.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/5/11	2017/11/10	160,796.0	10,500.01		0.0000%	6.5645%		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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/4/28			13,362	4,508	0.005		0.006	55.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/4/28			4,362	2,007	0.015		0.017	66.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/4/28			2,831	1,005	0.018		0.020	79.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,801	2017/4/26	2017/4/27		2,388	2,388		▲0.600	▲0.600	

●2017年4月27日の予定

*日銀政策委員会金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
*黒田日銀総裁、定例会見
*経済・物価情勢の展望

*ECB定例理事会(金融政策発表)
*米国3月の耐久財新規受注

◆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ご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