

Central Daily Market Report

2017年4月27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27日		2017年4月28日		2017年5月1日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 3,400	▲ 3,400	▲ 3,400	▲ 3,400	▲ 4,000	▲ 4,000
財政	▲ 8,400	5,100	▲ 1,000	▲ 1,000	▲ 1,000	▲ 1,000
資金過不足	▲ 11,800	1,700	▲ 5,000	▲ 5,000	▲ 5,000	▲ 5,000
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					2,600	▲ 2,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,600			
CP等買入		▲ 300	3,500	▲ 1,500		
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		▲ 200		
E T F買入	700		700			
国債補充供給	▲ 2,600	2,400	2,600			
当増増減	▲ 11,700		14,400		▲ 5,100	
当座預金残高	3,554,200		3,568,600		3,563,500	
準備預金残高	3,170,400					
積み終了先	2,666,400				4月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,666,400				積数	5,600
非準備預金先	383,800				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	99.75%	日数	40.00%		

●2017年4月27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7,000億円減の266兆7,000億円(当座預金残高は355兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.086~▲0.085%、地銀業態から▲0.086~▲0.07%、証券業態から▲0.086~▲0.08%の調達で始まった。一巡後は▲0.08~▲0.07%近辺での出合いが見られた。ターム物は閑散な地合いだった。本日の共通担保資金供給オベは2W物8,000億円のオファーに対し、落札額は2,550億円。期落ち額2,650億円に対してほぼ横ばいの応札で札割れとなった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(4/28-5/1)が▲0.100~▲0.09%程度、S/N(5/1-5/2)が▲0.095~▲0.085%程度の出合いだった。S/Nは短国発行要因でレート上昇となった。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、346、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、3M▲0.145~▲0.14%、1Y▲0.19~▲0.175%で散発的に出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還は少額だったものの、鉄鋼・ノンバンク・石油業態等から大型発行案件が実施され、4,600億円程度にまで膨らんだ。発行レートに目立った変動は無く、0%付近での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	0.015	▲ 0.001	19,251.87	▲ 37.56	111.17-18	111.26-28
T/N	▲ 0.082	▲ 0.040	▲ 0.074				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.045	0.002	▲ 0.025				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.119						
1M			▲ 0.050				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.142	▲ 0.131						
6M							▲ 0.149	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.211						
									日付	4/20	4/21	4/24	4/25	4/26
									日銀当預残	3,552,700	3,568,100	3,536,500	3,553,600	3,565,900
									準備預金残	3,172,700	3,169,700	3,168,400	3,174,300	3,180,300
									マネタリーベース	4,594,900	4,611,900	4,581,400	4,600,400	4,615,600
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.066%	▲0.070%	▲0.074%	▲0.074%
									コール市場残高	96,744	95,810	89,419	86,789	86,680
									うち無担	76,590	75,529	69,975	66,654	67,239
									うちO/N	49,475	45,045	41,050	37,517	37,132
									うち有担	20,154	20,281	19,444	20,135	19,441

●入札結果

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。

●オベ結果

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	2017/5/1	2017/5/15		2,550	2,550				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	71,801	2017/4/27	2017/4/28		2,442	2,442		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	28,636	2017/4/27	2017/4/28		64	64		▲0.600	▲0.600	

●2017年4月28日の予定

- *3月の完全失業率(市場予想:2.9%) *3月の有効求人倍率(市場予想:1.43倍)
- *3月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲0.3%)
- *3月全国・4月都区部消費者物価指数(CPI)
- 市場予想：全国(3月)前年同月比(除く生鮮)：+0.3%、東京都区部(4月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.2%
- *3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲0.8%) *3月の商業動態統計速報 *3月の住宅着工統計
- *米国1-3月期のGDP速報値
- *米国4月のシカゴPM景況感指数
- *英国1-3月期のGDP速報値
- *ユーロ圏4月の消費者物価指数速報値
- *2年利付国債入札(22,000億円、5/15発行)

●日銀金融政策決定会合・結果

- 現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。
- (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2)
 - 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
 - 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。
- (2)資産買入れ方針(賛成7反対2)(長期国債以外の資産の買入れについて)
 - ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆本資料は信頼できるとさ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