

Central Daily Market Report

2017年4月28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28日		2017年5月1日		2017年5月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,500		▲ 2,300		▲ 2,000	
財政	4,100		▲ 9,300		▲ 7,000	
資金過不足	600		▲ 11,600		▲ 9,000	
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					5,000	
国債買入	7,600					
CP等買入	3,500	▲ 1,500		▲ 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	700					
国債補完供給	▲ 2,400	2,600		2,400		
当預増減	10,900		▲ 9,600		▲ 4,000	
当座預金残高	3,565,100		3,555,500		3,551,500	
準備預金残高	3,182,500					
積み終了先	2,683,200		5月1日以降の残り所要積立額		積数 3,600	
超過準備	2,683,200		1日平均		200	
非準備預金先	382,600					
積み期間 (4/16~5/15) の所要準備額					2,221,800	
準備預金進捗率	実績	99.84%	日数	50.00%		

●2017年4月28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3兆円増の269兆7,000億円(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~▲0.085%、地銀業態から▲0.086~▲0.05%、証券業態から▲0.086~▲0.065%の調達で始まった。昨日よりも若干出合いレートは上昇したものの、取り急ぐ動きは見られず、一巡後は▲0.086~▲0.08%近辺での出合いが見られた。ターム物の出合いはロール案件中心の取引であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(5/1-5/2)が▲0.095~▲0.09%程度、S/N(5/2-5/8)が▲0.105~▲0.095%程度の出合いだった。S/Nは連休で6日物取引をなっており、資金調達サイドが慎重でレート低下となった。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。本日は短国買入オベが、前回比で5,000億円減額の5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差▲0.006%の落ち着いた決着となった。アウトライト市場は3M▲0.16~▲0.142%で出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は発行案件があまり多くはなかったものの、ノンバンク・石油業態等から大型発行案件が見られ、総額2,500億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移し、0%近辺の決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/28	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	▲ 0.074				-	▲ 0.089	0.010	▲ 0.005	19,196.74	▲ 55.13	111.22-24	111.28-29
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.058	▲ 0.030	▲ 0.039				-	▲ 0.117						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.119						
3W	▲ 0.038	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.119						
1M	0.001	0.005	0.004				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.142	▲ 0.131						
6M							▲ 0.148	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.211						
									日付	4/21	4/24	4/25	4/26	4/27
									日銀当預残	3,568,100	3,536,500	3,553,600	3,565,900	3,554,200
									準備預金残	3,169,700	3,168,400	3,174,300	3,180,300	3,170,400
									マネタリーベース	4,611,900	4,581,400	4,600,400	4,615,600	4,607,300
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.070%	▲0.074%	▲0.074%	▲0.075%
									コール市場残高	95,810	89,419	86,789	86,680	82,404
									うち無担	75,529	69,975	66,654	67,239	63,605
									うちO/N	45,045	41,050	37,517	37,132	33,320
									うち有担	20,281	19,444	20,135	19,441	18,799

●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)
2年利付国債	376	0.10%	22,000	2017/5/15	2019/5/15	109,647.0	19,883.00	100.5850	▲0.1910%	97.2833%	100.5890	▲0.1930%	2,111.0

●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	5,000	2017/5/2			16,645	5,000	▲0.006		0.001	33.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,393	2017/4/28	2017/5/1		2,285	2,285		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/4/28	2017/5/1		62	62		▲0.600	▲0.600	

●2017年5月1日の予定

*米国3月の個人所得・消費支出	*EURO祝日(Labour Day)	*国庫短期証券(680回)入札
*米国4月のISM 製造業景況指数	*London祝日(May Day)	(3ヶ月、44,000億円、5/8発行)

◆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