

Central Daily Market Report

2017年5月2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5月2日		2017年5月8日		2017年5月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		4,800		7,000	
財政	▲ 8,000		▲ 44,200		1,000	
資金過不足	▲ 9,000		▲ 39,400		8,000	
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			1,700	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000				5,000	
国債買入			10,700			
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 1,800	1,800		1,800		
当預増減	▲ 4,000		▲ 26,900		13,000	
当座預金残高	3,549,700		3,522,800		3,535,800	
準備預金残高	3,175,000					
積み終了先	2,669,300					
超過準備	2,669,200					
非準備預金先	374,700					
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	99.94%	日数	73.33%		

●2017年5月2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1兆5,000億円減少の267兆4,000億円(当座預金残高見込みは355兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・証券を中心に▲0.086~▲0.07%の調達希望で始まった。レートは低水準ながらも小幅上昇基調で、立ち上がりは▲0.08~▲0.07%近辺の出会い。一巡後は▲0.086~▲0.075%の出会いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は引き続きロール案件が散見された程度であった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(5/8-5/9)が▲0.085~▲0.070%程度、S/N(5/9-5/10)が▲0.085~▲0.075%程度の出合い。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、20y160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、短国買入オペアが事前予想通りの5,000億円でオファーされた。平均利回較差▲0.001%、按分利回較差▲0.004%と、比較的落ち着いた結果となった。その後は、3M物が▲0.138~▲0.135%の出合いが散見された程度となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は償還総額1,500億円弱に対して、発行総額は500億円強と償還超。連休の谷間となり発行市場は案件少なく、閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/5/2	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	▲ 0.070				-	▲ 0.086	0.015	0.005	19,445.70	135.18	111.82-83	112.16-18
T/N	▲ 0.010	0.010	▲ 0.009				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.048				-	▲ 0.103						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.136	▲ 0.130						
6M							▲ 0.143	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.143	▲ 0.211						
									日付	4/25	4/26	4/27	4/28	5/1
									日銀当預残	3,553,600	3,565,900	3,554,200	3,565,100	3,553,700
									準備預金残	3,174,300	3,180,300	3,170,400	3,182,500	3,186,200
									マネタリーベース	4,600,400	4,615,600	4,607,300	4,621,800	4,612,800
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.074%	▲0.075%	▲0.074%	▲0.074%
									コール市場残高	86,789	86,680	82,404	81,143	88,161
									うち無担	66,654	67,239	63,605	61,184	68,187
									うちO/N	37,517	37,132	33,320	34,084	40,633
									うち有担	20,135	19,441	18,799	19,959	19,974

●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	237	-	2,000	2017/5/9	-	9,076.0	1,995.00		▲0.0150%	11.4583%		▲0.0170%	

●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	5000	2017/5/9			19,970	5003	▲0.004		▲0.001	1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,801	2017/5/2	2017/5/8		1,754	1,754		▲0.600	▲0.600	

●2017年5月3日の予定

- *憲法記念日
- *米国FOMC(2日目)
- *米国4月のISM非製造業景況指数
- *ユーロ圏1-3月期GDP1次速報

●2017年5月4日の予定

- *みどりの日
- *米国3月の貿易収支
- *米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫

●2017年5月5日の予定

- *こどもの日
- *米国3月の消費者信用残高
- *米国4月の雇用統計

●2017年5月8日の予定

- *4月の消費動向調査
- *5月の日銀当座預金増減要因見込み
- *米国4月のFRB労働市場情勢指数

◆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