

Central Daily Market Report

2017年5月8日(月)

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8日 | | 2017年5月9日 | | 2017年5月10日 | |
|-----------------------|-----------|--------|-----------|--------|------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 4,700 | | 4,000 | | 5,000 | |
| 財政 | ▲46,800 | | 5,200 | | 1,000 | |
| 資金過不足 | ▲42,100 | | 9,200 | | 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 | 1,700 | ▲1,500 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | 5,000 | | | |
| 国債買入 | 10,700 | | | | 3,700 | |
| CP等買入 | | ▲200 | | ▲600 | | |
| 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 | ▲2,500 | 1,800 | | 2,500 | | |
| 当預増減 | ▲32,100 | | 16,100 | | 9,700 | |
| 当座預金残高 | 3,517,600 | | 3,533,700 | | 3,543,400 | |
| 準備預金残高 | 3,175,500 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,673,400 | | | | | |
| 超過準備 | 2,673,400 | | | | | |
| 非準備預金先 | 342,100 | | | | | |
| 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 | 99.95% | 日数 | 76.67% | | |

●2017年5月8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3,000億円減少の267兆1,000億円(当座預金残高見込みは352兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・証券を中心に▲0.08~▲0.07%の調達希望で始まった。レートは連休前と同様に小幅上昇基調で、立ち上がりは▲0.07%の出合い。一巡後は閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は引き続き閑散で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(5/9-5/10)が▲0.080~▲0.075%程度、S/N(5/10-5/11)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5y126、127、130、131、10y336、343、346、20y160等にビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。連休明けかつ週初ということもあり、3Mが▲0.145~▲0.1425%で出合った程度と、動意なく閑散な地合いとなった。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。発行市場は、五・十日発行にあつたものの、案件は膨らまず、償還総額3,000億円程に対し、発行総額は400億円程度にとどまった。発行レートは、特段の変化は見られず、引き続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

| 2017/5/8 | 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 | ▲0.065 | | | | - | ▲0.082 | 0.025 | 0.010 | 19,895.70 | 450.00 | 112.65-67 | 112.55-56 |
| T/N | | | ▲0.001 | | | | - | ▲0.077 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲0.050 | ▲0.040 | ▲0.046 | | | | - | ▲0.091 | | | | | | |
| 2W | ▲0.040 | 0.000 | ▲0.025 | | | | - | ▲0.096 | | | | | | |
| 3W | | | ▲0.030 | | | | - | ▲0.101 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲0.105 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲0.138 | ▲0.127 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲0.140 | ▲0.182 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲0.140 | ▲0.211 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 4/26 | 4/27 | 4/28 | 5/1 | 5/2 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,565,900 | 3,554,200 | 3,565,100 | 3,553,700 | 3,549,700 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,180,300 | 3,170,400 | 3,182,500 | 3,186,200 | 3,175,000 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,615,600 | 4,607,300 | 4,621,800 | 4,612,800 | 4,609,900 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.074% | ▲0.075% | ▲0.074% | ▲0.074% | ▲0.070% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 86,680 | 82,404 | 81,143 | 88,161 | 88,998 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 67,239 | 63,605 | 61,184 | 68,187 | 66,124 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 37,132 | 33,320 | 34,084 | 40,633 | 38,121 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 19,441 | 18,799 | 19,959 | 19,974 | 22,874 |

●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) | 応募額(億円) | 募入最低額 | 募入最高利回 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回 | 第1非価格競争入札(億円) |
|-----------------------------|----|------|-------|-----|-----|---------|---------|-------|--------|-----|--------|--------|---------------|
| 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1年以下) | 700 | 2017/5/10 | | | 5,986 | 700 | 0.041 | | 0.048 | 62.0 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 2,000 | 2017/5/10 | | | 6,573 | 2,011 | 0.008 | | 0.009 | 54.3 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 1,000 | 2017/5/10 | | | 3,811 | 1,007 | 0.008 | | 0.008 | 90.1 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 37,123 | 2017/5/8 | 2017/5/9 | | 2,466 | 2,466 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |

●2017年5月9日の予定

| | | |
|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| *3月の毎月勤労統計調査速報 | *10年利付国債入札(23,000億円、5/11発行) | *交付税特別会計借入(10,500億円、5/17借入) |
| *米国3月の卸売売上高 | | |

◆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