

Central Daily Market Report

2017年4月11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4月11日		2017年4月12日		2017年4月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		600			0
財政	1,000		1,400			▲ 4,000
資金過不足	2,000		2,000			▲ 4,000
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	20,000					
国債買入	10,100					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	200					
国債補完供給	▲ 1,800	1,800		1,800		
当預増減	32,100		3,600			▲ 4,000
当座預金残高	3,475,300		3,478,900			3,474,900
準備預金残高	3,108,900					
積み終了先	2,616,300				4月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,616,300				積数	100
非準備預金先	366,400				1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						2,262,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	87.10%		

●2017年4月11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2兆5,000億円増加の262兆2,000億円(当座預金残高見込みは348兆円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態などから▲0.05~▲0.04%、証券業態から▲0.04~▲0.035%、地銀業態から▲0.04~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。昨日ほどの取り上がりは見られなかったものの、▲0.05%近辺では底堅くビッドが入ったことから、朝方は▲0.05~▲0.02%のレンジでの出会い。一巡後も水準はほぼ変わらず▲0.05~▲0.03%のレンジの出会いで推移した。ターム物は閑散な出会いだった。

<レポ市場>

GC T/N(4/12-4/13)は、▲0.025~▲0.015%程度の出会い。S/N(4/13-4/14)は、▲0.025~▲0.02%程度で出会いが見られた。引き続き資金調達意欲が強く、売物はしっかりとっている。SCでは、ロールオーバー中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、5Y130~131、10Y334~346、30Y50~54などに引き続きビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は小幅上昇した。アウトライト市場は、店頭での買いからか、3M物が▲0.145~▲0.14%、1Y物が▲0.13%での出会いがあった。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。CP発行市場は、商社、小売、石油業態から大型発行案件が実施され、発行総額は1,600億円程度とやや膨らんだ。発行レートは引き続き0%近辺での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2017/4/11	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	▲ 0.054	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.027	0.035	▲ 0.010	18,747.87	▲ 50.01	110.70-71	110.54-56
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.021						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.068						
2W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.140	▲ 0.135						
6M							▲ 0.155	▲ 0.189						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.211						
									日付	4/4	4/5	4/6	4/7	4/10
									日銀当預残	3,460,900	3,473,200	3,456,100	3,474,100	3,443,200
									準備預金残	3,092,100	3,100,900	3,102,100	3,120,200	3,090,800
									マネタリーベース	4,503,800	4,515,100	4,497,600	4,515,200	4,482,900
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.052%	▲0.042%	▲0.035%	▲0.037%
									コール市場残高	87,836	90,755	97,469	94,941	84,806
									うち無担	68,415	71,497	77,877	75,233	64,412
									うちO/N	49,560	51,457	56,309	52,958	42,196
									うち有担	19,421	19,258	19,592	19,708	20,394

●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)
物価連動10年	22	0.10%	4,000	2017/4/13	2027/3/10	14,523.0	3,995.0	105.0000	▲0.3850%	50.5643%			
エネルギー対策	-	-	7,000	2017/4/20		63,361.0	6,999.96		0.0000%	11.1825%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,801	2017/4/11	2017/4/12		1,716	1,716		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	992	2017/4/11	2017/4/12		85	85		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/4/13	2017/4/20	1.4	0	0				

●2017年4月12日の予定

*2月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+2.7%)

*米3月の財政収支

◆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