

# Central Daily Market Report

2017年4月19日(水)

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19日		2017年4月20日		2017年4月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 2,100		▲ 3,000	
財政	4,700		▲ 36,200		5,000	
資金過不足	4,100		▲ 38,300		2,000	
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						
国債買入	5,600				10,800	
CP等買入	3,500 ▲ 300		▲ 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			▲ 100		1,100	▲ 1,100
E T F買入	500		600			
国債補完供給	▲ 9,200 9,400		9,200			
当預増減	13,600		▲ 28,900		12,800	
当座預金残高	3,583,400		3,554,500		3,567,300	
準備預金残高	3,196,600					
積み終了先	2,675,800		4月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,670,900		積数		26,600	
非準備預金先	386,800		1日平均		1,000	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					2,220,900	
準備預金進捗率	実績	98.80%	日数	13.33%		

## ●2017年4月19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、前日横ばいの270兆1,000億円(当座預金残高は359兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行を中心に▲0.07~▲0.065%、証券業態から▲0.07~▲0.05%、地銀業態から▲0.04~▲0.02%の調達で始まった。昨日よりも地銀業態の調達意欲は弱含み、取り手は減少した。一巡後は▲0.07%近辺での出会いが見られ、本日の取引を終了した。ターム物は、ショートターム物の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC取引はT/N(4/20-4/21)が▲0.095~▲0.09%程度、S/N(4/21-4/24)が▲0.105~▲0.095%程度の出合いだった。前日に引き続き資金調達意欲は弱く、足元GCレートはほぼ下限に近い水準で推移した。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5y121、123、130、10y334、336、343、20y160、30y51、52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推移。アウトライ市場は3M▲0.14~▲0.135%、6M▲0.155%、1Y▲0.201~▲0.195%の出合いが見られる等、全般的に堅調な展開となった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場はノンバンク業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は600億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/4/19	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.088	0.000	▲ 0.010	18,432.20	13.61	108.53-55	108.81-83
T/N	▲ 0.070	▲ 0.015	▲ 0.052				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.130	▲ 0.131						
6M							▲ 0.145	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.194	▲ 0.211						
									日付	4/12	4/13	4/14	4/17	4/18
									日銀当預残	3,478,100	3,479,000	3,568,400	3,543,600	3,569,800
									準備預金残	3,116,100	3,110,800	3,191,600	3,172,200	3,199,200
									マナタリーベース	4,516,100	4,517,900	4,608,400	4,583,000	4,609,300
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.034%	▲0.047%	▲0.054%	▲0.053%
									コール市場残高	84,968	87,796	90,109	93,896	95,499
									うち無担	65,240	68,606	70,718	73,447	74,959
									うちO/N	42,270	45,901	49,957	50,657	51,005
									うち有担	19,728	19,190	19,391	20,449	20,540

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/4/28	2017/10/26	152,623.0	10,500.12		0.0000%	6.9164%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/4/21			12,389	2,804	▲0.007		▲0.006	28.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2017/4/21			10,845	3,503	▲0.011		▲0.010	91.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/4/21			17,382	4,511	▲0.008		▲0.008	78.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,600	2017/4/19	2017/4/20		9,036	9,036		▲0.600	▲0.628	

## ●2017年4月20日の予定

*月例経済報告 *3月の貿易統計	*国庫短期証券(678回)入札 (3ヶ月、44,000億円、4/24発行)	*20年利付国債入札 (10,000億円、4/24発行)
---------------------	--	---------------------------------

◆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