

Central Daily Market Report

2017年5月12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5月12日		2017年5月15日		2017年5月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,500		1,900		1,000	
財政	▲ 21,000		▲ 32,400		3,000	
資金過不足	▲ 19,500		▲ 30,500		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			2,600	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	10,500				7,500	
CP等買入	2,500	▲ 300		▲ 400		
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	▲ 900	800		900		
当預増減	▲ 6,900		▲ 30,000		21,500	
当座預金残高	3,506,800		3,476,800		3,498,300	
準備預金残高	3,150,200					
積み終了先	2,639,000					
超過準備	2,638,900					
非準備預金先	356,600					
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					2,240,700	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.67%		

●2017年5月12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9,000億円減少の264兆2,000億円(当座預金残高見込みは350兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは信託・地銀・証券を中心に▲0.045~▲0.04%の調達希望で始まった。本日は週末要因や積み最終日に向けた調整から取り上がり、立ち上がりは▲0.035%の出合い。一巡後は調達意欲が弱く、幅広いレンジでの出合いが散見された。ターム物は閑散で出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC取引はT/N(5/15-5/16)が▲0.070~▲0.040%程度、S/N(5/16-5/17)が▲0.090~▲0.080%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、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。本日は、短国買入オペアが事前予想通りの1兆円でオファーされた。結果は、平均利回較差+0.002%、按分利回較差+0.001%と、応札額が3兆2,119億円と膨らんだにしては、比較的落ち着いた結果となった。出合いは、3M▲0.135~▲0.134%の水準で見られた。

<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、案件、金額共に少なく、償還総額340億円程に対し、発行総額は100億円弱と閑散なマーケットとなった。発行レートは引き続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/5/12	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.087	0.040	▲ 0.005	19,883.90	▲ 77.65	113.81-83	113.60-62
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.055						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.230	0.003				-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.020	0.003	▲ 0.019				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.133	▲ 0.129						
6M							▲ 0.136	▲ 0.178						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.207						
									日付	5/2	5/8	5/9	5/10	5/11
									日銀当預残	3,549,700	3,517,600	3,530,700	3,538,300	3,513,700
									準備預金残	3,175,000	3,175,500	3,163,500	3,164,700	3,157,800
									マネタリーベース	4,609,900	4,573,100	4,582,200	4,586,400	4,560,100
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.065%	▲0.053%	▲0.042%	▲0.039%
									コール市場残高	88,998	89,304	88,546	91,572	91,935
									うち無担	66,124	66,620	67,651	73,294	71,425
									うちO/N	38,121	40,660	41,919	48,359	45,789
									うち有担	22,874	22,684	20,895	18,278	20,510

●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
国庫短期証券買入	10,000	2017/5/16			32,119	10,001	0.001		0.002	97.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/5/16			9,721	4,503	▲0.001		0.001	69.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/5/16			3,930	2,013	0.003		0.004	82.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/5/16			3,108	1,002	0.009		0.013	50.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	42,168	2017/5/12	2017/5/15		884	884		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,537	2017/5/12	2017/5/15		30	30		▲0.500	▲0.500	

●2017年5月15日の予定

*3月の特定サービス産業動態統計速報
*4月の企業物価指数

◆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