

Central Daily Market Report

2017年3月6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3月6日		2017年3月7日		2017年3月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		500		2,000	
財政	▲ 5,100		3,200		5,000	
資金過不足	▲ 4,100		3,700		7,000	
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	1,600	▲ 1,600				
国債買現						
国庫短期証買入			2,500			
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 600		▲ 500		
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	300					
国債補完供給	▲ 600	1,100		600		
当預増減	▲ 3,900		14,300		7,000	
当座預金残高	3,246,300		3,260,600		3,267,600	
準備預金残高	2,900,900					
積み終了先	2,443,000		3月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,443,000		積数	900		
非準備預金先	345,400		1日平均	100		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						2,016,600
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	67.86%		

●2017年3月6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、前営業日比5,000億円減の244兆1,000億円(当座預金残高見込みは、324兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.05~▲0.015%の幅広いレンジでの出合いで始まった。先週末に続き調達ニーズが強く、一巡後も朝方とほぼ同水準のレートでの出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.015%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(3/7-3/8)は、▲0.14~▲0.10%程度の出合い。S/N(3/8-3/9)は、▲0.14~▲0.12%程度の出合い。T/N,S/Nともに引き続き▲0.10%を下回る水準での出合いが中心となった。SCでは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、5Y126~130、10Y343~345、30Y50~52などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏での推移。アウトライト市場は総じて閑散で、3M▲0.43%で少額の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還額は少額であったものの、食料品業態から大型の発行が実施され、1,100億円弱の発行となった。発行レートに目立った変動は見られず、期越えの案件に関しては引き続き強い買いが見られた。

●短期金融市場関連指標

2017/3/6	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.099	0.070	0.000	19,379.14	▲ 90.03	113.81-82	113.79-81
T/N			0.000				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.149						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.155						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.192						
3M							▲ 0.408	▲ 0.156						
6M							▲ 0.292	▲ 0.203						
1Y							▲ 0.446	▲ 0.223						
									日付	2/27	2/28	3/1	3/2	3/3
									日銀当預残	3,278,400	3,296,700	3,294,700	3,246,500	3,250,200
									準備預金残	2,934,000	2,937,700	2,942,400	2,900,500	2,902,300
									マネタリーベース	4,318,100	4,337,000	4,335,700	4,288,500	4,292,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.048%	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.037%
									コール市場残高	95,568	85,364	100,298	99,095	99,321
									うち無担	75,227	64,931	79,607	77,922	78,709
									うちO/N	51,553	44,814	56,997	55,085	56,585
									うち有担	20,341	20,433	20,691	21,173	20,612

●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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	99,910	2017/3/6	2017/3/7		413	413		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/3/6	2017/3/7		222	222		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月7日の予定

*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国1月の貿易収支	*30年利付国債入札(8,000億円、3/21発行)
	*米国1月の消費者信用残高	
	*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値	

◆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お客様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