

Central Daily Market Report

2017年3月8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3月8日		2017年3月9日		2017年3月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 300		0	
財政	5,900		1,800		▲ 5,000	
資金過不足	6,300		1,500		▲ 5,000	
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						
国庫短期証買入						
国債買入					7,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 300	5,000	
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	700					
国債補完供給	▲ 1,600	500		1,600		
当預増減	5,700		2,800		7,500	
当座預金残高	3,264,800		3,267,600		3,275,100	
準備預金残高	2,920,500					
積み終了先	2,461,100				3月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,461,100				積数	500
非準備預金先	344,300				1日平均	100
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						2,020,700
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	75.00%		

●2017年3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6,000億円増の246兆9,000億円(当座預金残高見込みは、326兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.045~▲0.015%の幅広いレンジでの出会いで始まった。昨日に比べ調達ニーズがやや強まり、一巡後も同水準のレートで散発的な出会いが見られる中、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%近辺での出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(3/9-3/10)は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。S/N(3/10-3/13)は、▲0.12~▲0.105%程度の出合い。S/Nは短期6M物の発行日ではあったが、運用サイドのほうに優勢でレートは上がらず、昨日S/Nと横ばいでの出合い水準となった。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、10Y336~345、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。本日は6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.35%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.3564%、按分落札利回▲0.3328%と概ね事前予想通りの順調な決着になった。セカンドラリーでは、6M物で▲0.38~▲0.35%で出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は五・十日発行にあたり、機械・商社業態等からの大型発行案件が見られたが、2,200億円程度の償還に対し、1,600億円強の発行にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となり、0%付近での決着が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/8	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.100	0.070	0.005		19,254.03	▲ 90.12	113.91-93	113.88-90
T/N			0.000				-	▲ 0.102							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.041	▲ 0.009	▲ 0.030				-	▲ 0.142							
2W							-	▲ 0.143							
3W	▲ 0.010	0.035	0.005				-	▲ 0.148							
1M							-	▲ 0.196							
3M							▲ 0.394	▲ 0.159							
6M							▲ 0.356	▲ 0.204							
1Y							▲ 0.451	▲ 0.223							
									日付	3/1	3/2	3/3	3/6	3/7	
									日銀当預残	3,294,700	3,246,500	3,250,200	3,246,300	3,259,100	
									準備預金残	2,942,400	2,900,500	2,902,300	2,900,900	2,924,700	
									マネタリーベース	4,335,700	4,288,500	4,292,600	4,287,700	4,299,800	
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.037%	▲ 0.038%	▲ 0.035%	
									コール市場残高	100,298	99,095	99,321	96,885	97,735	
									うち無担	79,607	77,922	78,709	77,151	77,184	
									うちO/N	56,997	55,085	56,585	55,747	55,648	
									うち有担	20,691	21,173	20,612	19,734	20,551	

●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	素分率	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)
国庫短期証券	668	-	32,000	2017/3/10	2017/9/11	120,213.0	28,978.80	100.1690	▲0.3328%	10.6442%	100.1810	▲0.3564%	3,021.0

●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5年超10年以下)	4,500	2017/3/10			10,249	4,505	▲0.002		0.000	50.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/3/10			4,412	2,008	0.011		0.014	24.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/3/10			3,140	1,001	0.017		0.022	78.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	69,102	2017/3/8	2017/3/9		1,544	1,544		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月9日の予定

*1月の毎月動労統計調査速報	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(669回)入札(3ヶ月、44,000億円、3/13発行)
*2月のマネーストック		5年利付国債入札(24,000億円、3/21発行)
*マクロ加算残高にかかる基準比率		

◆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。

◆本資料は何ら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