

Central Daily Market Report

2017年3月9日(木)

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9日		2017年3月10日		2017年3月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		0		1,000	
財政	▲ 300		1,100		▲ 14,000	
資金過不足	▲ 500		1,100		▲ 13,000	
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					1,300	▲ 1,400
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,000			
CP等買入		▲ 300	5,000	▲ 100		
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			600			
国債補完供給	▲ 400	1,600		400		
当預増減		400		15,000		▲ 13,100
当座預金残高		3,265,200		3,280,200		3,267,100
準備預金残高		2,923,700				
積み終了先		2,464,900		3月10日以降の残り所要積立額		
超過準備		2,464,900		積数		400
非準備預金先		341,500		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	78.57%		

●2017年3月9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、前日比横ばいの246兆9,000億円(当座預金残高見込みは、326兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.035~▲0.015%のレンジでの出会いと、昨日に比べ強めの立ち上がりとなった。一巡後も調達レートは下がらず、朝方と同水準のレンジでの出会いが散見される中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。共通担保資金供給オペは2W物8,000億円がオフアールされ、応札額1,300億円(期落ち分1,370億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(3/10~3/13)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(3/13~3/14)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/Nは短国3M物の発行要因から資金調達ニーズが増加し、レートは上昇した。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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.45%と強い水準で出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.4459%、按分落札利回▲0.4006%と共に過去最低を更新する結果となった。セカンダリーでは、3M物▲0.42%、6M物▲0.385~▲0.38%で出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は石油業態からまとまった発行が実施された程度で、全体的に案件も少なく閑散であった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/3/9	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.097	0.085	0.015	19,318.58	64.55	114.40-42	114.52-53
T/N			0.000				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.010	0.004				-	▲ 0.133						
2W	▲ 0.020	▲ 0.018	▲ 0.019				-	▲ 0.134						
3W			0.001				-	▲ 0.211						
1M			0.030				-	▲ 0.202						
3M							▲ 0.414	▲ 0.159						
6M							▲ 0.378	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.457	▲ 0.223						
									日付	3/2	3/3	3/6	3/7	3/8
									日銀当預残	3,246,500	3,250,200	3,246,300	3,259,100	3,264,800
									準備預金残	2,900,500	2,902,300	2,900,900	2,924,700	2,920,500
									マネタリーベース	4,288,500	4,292,600	4,287,700	4,299,800	4,305,100
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.037%	▲0.038%	▲0.035%	▲0.032%
									コール市場残高	99,095	99,321	96,885	97,735	94,513
									うち無担	77,922	78,709	77,151	77,184	75,297
									うちO/N	55,085	56,585	55,747	55,648	54,142
									うち有担	21,173	20,612	19,734	20,551	19,216

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	669	-	43,900	2017/3/13	2017/6/12	139,850.0	39,715.8	100.1000	▲0.4006%	55.9288%	100.1113	▲0.4459%	4,184.0
5年利付国債	131	0.10%	24,000	2017/3/21	2022/3/20	63,074.0	22,065.00	101.0600	▲0.1100%	83.8513%	101.1000	▲0.1180%	1,928.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2017/3/13	2017/3/27		1,300	1,300				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフアール)	49,679	2017/3/9	2017/3/10		418	418		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月10日の予定

*1-3月期の法人企業景気予測調査季報
*1月の特定サービス産業動態統計速報
*2月の企業物価指数

*米国2月の雇用統計
*米国2月の財政収支

*エネルギー対策借入
(3,000億円、3/21借入)

◆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