

# Central Daily Market Report

2017年3月10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3月10日 需給速報	2017年3月13日 需給予想	2017年3月14日 当社予想
銀行券	100	1,100	2,000
財政	1,300	▲ 15,300	3,000
資金過不足	1,400	▲ 14,200	5,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,300	▲ 1,400
国債買現			
国庫短期証買入			2,500
国債買入	8,000		10,000
CP等買入	5,000	▲ 100	▲ 600
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
E T F買入	600		
国債補完供給	▲ 300	400	300
当預増減	15,000	▲ 14,700	17,500
当座預金残高	3,280,200	3,265,500	3,283,000
準備預金残高	2,955,100		
積み終了先	2,496,700	3月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,496,600	積数	0
非準備預金先	325,100	1日平均	0
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	100.00%	日数
			89.29%

## ●2017年3月10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2兆8,000億円増の249兆7,000億円(当座預金残高見込みは、328兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.03~▲0.015%のレンジでの出合いで始まった。今積み期最後の週末の取引ということもあり、昨日よりも強めの立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、調整程度の出合いが散見される中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/13-3/14)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。S/N(3/14-3/15)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは国債・短国買入オペが通知されたものの、全体的に売り物が多く、前日比横ばいのレートで推移した。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、30Y50~53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。短国買入オペが市場予想より少ない2,500億円でオファーされ平均落札利回較差+0.036%、全取利回較差+0.034%の結果となった。オペの後は、3M物で▲0.399~▲0.36%の出合いが見られた程度で、閑散小動きであった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還は少額であったものの、機械・不動産業態から大型発行案件が実施され、1,400億円程度の発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏であったものの、期内償還物ではレートが若干上昇する動きも見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2017/3/10	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	▲ 0.029				-	▲ 0.094	0.085	0.000	19,604.61	286.03	115.12-14	115.40-41
T/N			0.000				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.018	0.100	0.007				-	▲ 0.123						
2W							-	▲ 0.125						
3W							-	▲ 0.231						
1M			0.003				-	▲ 0.205						
3M							▲ 0.382	▲ 0.159						
6M							▲ 0.365	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.443	▲ 0.223						
									日付	3/3	3/6	3/7	3/8	3/9
									日銀当預残	3,250,200	3,246,300	3,259,100	3,264,800	3,265,200
									準備預金残	2,902,300	2,900,900	2,924,700	2,920,500	2,924,300
									マネタリーベース	4,292,600	4,287,700	4,299,800	4,305,100	4,305,700
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.038%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.027%
									コール市場残高	99,321	96,885	97,735	94,513	95,682
									うち無担	78,709	77,151	77,184	75,297	75,232
									うちO/N	56,585	55,747	55,648	54,142	53,927
									うち有担	20,612	19,734	20,551	19,216	20,450

## ●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	棄分率	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)
エネルギー対策	-	-	3,000	2017/3/21	2018/3/20	34,872.0	2,999.98		0.0000%	8.7956%		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
国庫短期証券買入	2,500	2017/3/14			10,184	2,500		0.034	0.036	
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2017/3/14			9,172	3,001	0.010		0.016	82.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2017/3/14			8,727	4,004	▲0.005		▲0.003	53.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/3/14			5,323	2,006	0.006		0.008	90.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/3/14			2,710	1,002	0.003		0.006	40.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,536	2017/3/10	2017/3/13		279	279		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年3月13日の予定

\*1月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+0.5%)

\*米国2月のFRB労働市場情勢指数

\*2月の企業物価指数

\*1月のマネタリーサーベイ

\*1月の第3次産業活動指数

◆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