

Central Daily Market Report

2017年3月13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13日		2017年3月14日		2017年3月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		100		1,000	
財政	▲16,700		3,700		▲17,000	
資金過不足	▲15,500		3,800		▲16,000	
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			2,500			
国債買入			10,300		5,200	
CP等買入		▲600		▲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		▲100				
ETF買入						
国債補充供給	▲500	300		500		
当預増減	▲16,500		17,000		▲10,800	
当座預金残高	3,263,700		3,280,700		3,269,900	
準備預金残高	2,945,600					
積み終了先	2,489,000			3月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,489,000			積数	0	
非準備預金先	318,100			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	92.86%		

●2017年3月13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1兆2,000億円減の248兆5,000億円(当座預金残高見込みは、326兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.07~▲0.02%の幅広いレンジでの出合いで始まった。積みの着地に目処がついた先が多く、先週末よりも全体的な調達ニーズが低下したため、弱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、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%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(3/14-3/15)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(3/15-3/16)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。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S/N物は引き続き低位で推移した。3Mが▲0.36%で出合った程度で、閑散な地合いが続いた。

<CP市場>

CP市場は、五・十日発行に当たり、機械、ゴム製品、卸売業など複数業態でまとまった額の調達が行われ、償還総額、発行総額ともに3,100億円程度となった。発行レートについて、状況は変わらず、期越物は低位で推移している。期内物や大口の物に関しても、レート上昇圧力は生じておらず、0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/3/13	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	▲0.080	0.001	▲0.048				-	▲0.089	0.085	0.000		19,633.75	29.14	114.75-77	114.67-68
T/N							-	▲0.085							
S/N							-	-							
1W	▲0.008	▲0.001	▲0.005				-	▲0.120							
2W			▲0.015				-	▲0.121							
3W							-	▲0.288							
1M							-	▲0.233							
3M							▲0.378	▲0.159							
6M							▲0.353	▲0.204							
1Y							▲0.412	▲0.223							
									日付	3/6	3/7	3/8	3/9	3/10	
									日銀当預残	3,246,300	3,259,100	3,264,800	3,265,200	3,280,200	
									準備預金残	2,900,900	2,924,700	2,920,500	2,924,300	2,955,600	
									マネタリーベース	4,287,700	4,299,800	4,305,100	4,305,700	4,320,600	
									無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.027%	▲0.029%	
									コール市場残高	96,885	97,735	94,513	95,682	96,152	
									うち無担	77,151	77,184	75,297	75,232	76,583	
									うちO/N	55,747	55,648	54,142	53,927	56,317	
									うち有担	19,734	20,551	19,216	20,450	19,569	

●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/3/15			2,021	702	0.000		0.032	7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/3/15			12,574	4,509	▲0.006		▲0.004	11.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	71,486	2017/3/13	2017/3/14		479	479		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,653	2017/3/13	2017/3/14		1	1		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月14日の予定

*国庫短期証券(670回)入札 (1年、25,000億円、3/21発行)	*20年利付国債入札 (11,000億円、3/21発行)	*米国FOMC(1日目) *米国2月の生産者物価指数
---	---------------------------------	-------------------------------

◆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