

Central Daily Market Report

2017年3月15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15日		2017年3月16日		2017年3月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 900		▲ 2,000	
財政	▲ 14,700		3,300		8,000	
資金過不足	▲ 15,100		2,400		6,000	
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	5,300				10,000	
CP等買入		▲ 1,400		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					75,200	▲ 18,800
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入			300			
国債補完供給	▲ 1,800	2,700		1,800		
当預増減	▲ 10,300		4,300		72,400	
当座預金残高	3,267,100		3,271,400		3,343,800	
準備預金残高	2,946,400					
積み終了先	2,492,100				3月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,492,100				積数	2,243,400
非準備預金先	320,700				1日平均	72,400
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						2,243,400
準備預金進捗率	実績	0.00%		日数	0.00%	

●2017年3月15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1兆2,000億円減の249兆1,000億円(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▲0.06~▲0.02%の幅広いレンジでの出会いで始まった。積み最終日の取引ということで、着地に向けた調達ニーズが増加したため、昨日よりも強めの立ち上がりとなった。一巡後もレート水準は変わらず、朝方と同水準のレンジでの出会いが散見される中、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出会いが数件見られた程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(3/16-3/17)は、▲0.090~▲0.080%程度の出会い。S/N(3/17-3/21)は、▲0.105~▲0.085%程度程度の出会い。S/Nは、投資家の資金調達ニーズの弱さから▲0.100%近辺まで買い進まれた。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などにビッドの入札が多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。本日は3M物の入札が実施された。WIで▲0.325%の出会いが見られる中、店頭ニーズからか、平均落札利回▲0.3217%、按分落札利回▲0.3039%と順調な入札結果となった。その後は小じっかりと推移した。出会いは、3M▲0.34~0.325%、6M▲0.325~▲0.30%、1Y▲0.295~▲0.29%の水準でみられた。

<CP市場>

CP市場は、ノンバンク、輸送用機械、化学業態等で比較的多くまとった額の調達が行われたが、発行総額は1,100億円程度と、償還総額1,400億円弱を下回った。発行レートは、全体的に横ばい圏でありながらも、期越物を中心に低下余地を探る展開となった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.088	0.090	0.005	19,577.38	▲ 32.12	114.65-67	114.69-70
T/N			0.000				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.117						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.329						
1M							-	▲ 0.251						
3M							▲ 0.333	▲ 0.165						
6M							▲ 0.309	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.294	▲ 0.223						
									日付	3/8	3/9	3/10	3/13	3/14
									日銀当預残	3,264,800	3,265,200	3,280,200	3,263,700	3,277,400
									準備預金残	2,920,500	2,924,300	2,955,600	2,945,600	2,956,200
									マネタリーベース	4,305,100	4,305,700	4,320,600	4,303,000	4,316,400
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.027%	▲0.029%	▲0.048%	▲0.053%
									コール市場残高	94,513	95,682	96,152	91,626	93,883
									うち無担	75,297	75,232	76,583	70,855	73,699
									うちO/N	54,142	53,927	56,317	48,178	51,034
									うち有担	19,216	20,450	19,569	20,771	20,184

●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	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	671	-	43,900	2017/3/21	2017/6/19	145,974.0	39,677.9	100.0750	▲0.3039%	26.3269%	100.0794	▲0.3217%	4,222.0

●オペ結果

種類	オフター額(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年超3年以下)	3,000	2017/3/17			8,469	3,005	0.007		0.010	61.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2017/3/17			10,099	4,006	▲0.005		▲0.004	39.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/3/17			5,367	2,007	▲0.002		▲0.001	98.5
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/3/17			3,389	1,004	▲0.009		▲0.007	79.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オフター分))	71,064	2017/3/15	2017/3/16		1,800	1,800		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間1年(借り換え)	2017/3/17	2018/3/16	0	11,803
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2017/3/17	2021/3/17	0	63,355

●2017年3月16日の予定

*日銀金融政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*黒田日銀総裁、定例会見 *英中銀MPC結果発表	*米国2月の住宅着工件数 *ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値
-------------------------------------	-----------------------------	------------------------------------

◆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