

Central Daily Market Report

2017年3月17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17日		2017年3月21日		2017年3月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		100		0	
財政	5,300		55,500		4,000	
資金過不足	3,900		55,600		4,000	
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			3,100	▲ 1,500		
国債買現						
国庫短期証買入					5,000	
国債買入	10,400					
CP等買入		▲ 600		▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	75,200	▲ 31,700				
被災地支援						
社債等買入		▲ 400				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 4,400	1,500		4,400		
当預増減	53,900		60,500		9,000	
当座預金残高	3,322,200		3,382,700		3,391,700	
準備預金残高	2,981,400					
積み終了先	2,512,900		3月21日以降の残り所要積立額		積数 34,200	
超過準備	2,428,500		1日平均		1,300	
非準備預金先	340,800					
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	98.48%	日数	16.13%		

●2017年3月17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6兆円増の254兆4,000億円(当座預金残高は332兆7,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態で▲0.045~▲0.02%の出会いと連休挟みの週末のためか、やや強めの立ち上がりとなった。一巡後も▲0.05~▲0.02%のレンジでの出会いと堅調な展開。ターム物に関しては月内エンドのショートタームで▲0.015%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(3/21-3/22)は、▲0.08~▲0.07%程度 of 出会い。S/N(3/22-3/23)は、▲0.08~▲0.07%程度 of 出会い。S/Nは短国買入オベが通知されたものの、引続き業者・投資家ともにファンディングニーズが強く、レートは横ばいとなった。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、5Y126~131、10Y336~346、30Y50~54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物は引続き低位で推移した。本日は、短国買入オベが事前予想通りの5,000億円でオファーされた。平均利回較差+0.010%、按分利回較差+0.002%と、やや甘めではあるものの比較的落ち着いた結果となった。その後は、3M物が▲0.30%、1Y物が▲0.30~▲0.29%の出会いが散見された程度であった。

<CP市場>

CP市場は発行総額250億円程度、償還総額500億円程度と、ともに膨らまず、閑散なマーケットとなった。発行レートに特段の変化は見られず、引続き低位で推移している。本日は、CP等買入オベが5,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.021%・按分落札レート▲0.032%と前回(平均▲0.005%・按分▲0.009%)比で低下する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/17	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.084	0.070	0.000	19,521.59	▲ 68.55	113.36-38	113.43-44
T/N			0.000				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.108						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.390						
3W							-	▲ 0.310						
1M							-	▲ 0.261						
3M							▲ 0.335	▲ 0.170						
6M							▲ 0.300	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.291	▲ 0.223						
									日付	3/10	3/13	3/14	3/15	3/16
									日銀当預残	3,280,200	3,263,700	3,277,400	3,267,100	3,268,300
									準備預金残	2,955,600	2,945,600	2,956,200	2,947,200	2,935,700
									マネタリーベース	4,320,600	4,303,000	4,316,400	4,306,500	4,308,600
									無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.048%	▲0.053%	▲0.046%	▲0.043%
									コール市場残高	96,152	91,626	93,883	93,807	87,500
									うち無担	76,583	70,855	73,699	74,129	68,168
									うちO/N	56,317	48,178	51,034	52,948	46,849
									うち有担	19,569	20,771	20,184	19,678	19,332

●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)
流動性供給	233	-	2,000	2017/3/22	-	10,689.0	1,993.00		▲0.0120%	41.5307%		▲0.0140%	

●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	5,000	2017/3/22			13,955	5,000	0.002		0.010	64.7
CP等買入	5,000	2017/3/23			11,619	4,996	▲0.032		▲0.021	10.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	58,589	2017/3/17	2017/3/21		4,235	4,235		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	17,030	2017/3/17	2017/3/21		25	25		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第71回	2017/3/24	2018/3/23	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第10回	2017/3/24	2018/3/23	0

●2017年3月21日の予定

*英国2月の消費者物価指数

◆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