

Central Daily Market Report

2017年3月23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23日		2017年3月24日		2017年3月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 700		0	
財政	800		1,200		14,000	
資金過不足	▲ 500		500		14,000	
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					3,900	▲ 1,300
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,600				4,000	
CP等買入	5,000	▲ 300		▲ 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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 3,200	3,600		3,200		
当預増減	16,200		3,100		20,600	
当座預金残高	3,394,000		3,397,100		3,417,700	
準備預金残高	3,043,100					
積み終了先	2,534,500		3月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,534,500		積数		17,400	
非準備預金先	350,900		1日平均		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	99.22%	日数	25.81%		

●2017年3月23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2兆円増の254兆6,000億円(当座預金残高は339兆8,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態で▲0.055~▲0.02%の立ち上がりとなった。一巡後は▲0.045~▲0.03%で一部出合い、午後は調整から▲0.06%の出合いが見られた。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.02%の出合いが見られた。固定金利方式の共通担保資金供給オペアは2W物が8,000億円オフアされ、3,900億円の応札で未達となった。

<レポ市場>

GC T/N(3/24-3/27)は、▲0.075~▲0.065%程度の出合い。S/N(3/27-3/28)は、▲0.06~▲0.055%程度の出合い。S/Nは短国発行要因からレートを切り上げての出合いとなった。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、5Y129~131、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T/Nは低水準で推移。本日は新発3M物の入札が実施された。平均落札利回▲0.3398%、按分落札利回▲0.3166%と、期末の担保需要から堅調な結果となった。セカンダリー市場では3M物で▲0.35%、1Y物で▲0.325~▲0.31%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額2,500億円強に対して、発行総額は3,000億円弱と若干の発行超。発行レートは概ね横ばいで推移した。一部の期越え物では強めの決着が見られた。

●短期金融市場関連指標

2017/3/23	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.086	0.050	▲ 0.005	19,085.31	43.93	111.36-38	111.23-25
T/N	▲ 0.001	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.018	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.788						
2W	▲ 0.015	0.030	0.000				-	▲ 0.521						
3W							-	▲ 0.412						
1M							-	▲ 0.280						
3M							▲ 0.342	▲ 0.169						
6M							▲ 0.301	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.299	▲ 0.223						
									日付	3/15	3/16	3/17	3/21	3/22
									日銀当預残	3,267,100	3,268,300	3,322,200	3,378,000	3,377,800
									準備預金残	2,947,200	2,935,700	2,981,400	3,042,500	3,025,300
									マネタリーベース	4,306,500	4,308,600	4,364,000	4,419,500	4,419,000
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.043%	▲0.039%	▲0.042%	▲0.039%
									コール市場残高	93,807	87,500	99,230	94,238	89,716
									うち無担	74,129	68,168	80,195	73,401	69,059
									うちO/N	52,948	46,849	58,819	52,576	47,740
									うち有担	19,678	19,332	19,035	20,837	20,657

●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	素分率	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	672	-	43,500	2017/3/27	2017/6/26	150,881.0	39,421.8	100.0790	▲0.3166%	0.9629%	100.0848	▲0.3398%	4,078.0

●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	2017/3/27	2017/4/10		3,900	3,900				
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/3/27			2,870	706	0.001		0.007	51.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/3/27			5,800	2,008	▲0.002		▲0.001	88.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/3/27			3,195	1,002	▲0.009		▲0.007	49.0
国債買入(物価連動債)	250	2017/3/27			928	251	▲0.070		▲0.110	100.0
社債等買入	1,000	2017/3/29			4,391	1,000	▲0.014		▲0.007	67.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	90,385	2017/3/23	2017/3/24		3,072	3,072		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)	19,913	2017/3/23	2017/3/24		64	64		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月24日の予定

*1月の景気動向指数改訂状況

*米国2月の耐久財新規受注

◆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