

# Central Daily Market Report

2017年3月24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24日		2017年3月27日		2017年3月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		300			0
財政	300		19,400			7,000
資金過不足	▲ 400		19,700			7,000
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						
国債売現			▲ 10,000			
国庫短期証買入						
国債買入			4,100			
CP等買入		▲ 600		▲ 1,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 3,300	3,200		3,300		
当預増減	▲ 1,100		18,400			7,000
当座預金残高	3,392,900		3,411,300		3,418,300	
準備預金残高	3,051,400					
積み終了先	2,541,200		3月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,540,300		積数		12,600	
非準備預金先	341,500		1日平均		600	
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	99.44%	日数	35.48%		

## ●2017年3月24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9,000億円増の25兆5,000億円(当座預金残高は339兆7,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態で▲0.055~▲0.02%の立ち上がり前日比ほぼ横ばいとなった。週末の取引となるが、取り上がる動きは限定的で、一巡後も▲0.05~▲0.02%のレンジでの出会いが中心となった。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.02%程度の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/27-3/28)は、▲0.040~▲0.025%程度の出合い。S/N(3/28-3/29)は、▲0.03~▲0.025%程度の出合い。T/Nは売現先オペ、S/Nはそれに加えて短国買入オペ見送りの影響もあって、一段とレートを切り上げた水準での出合いとなった。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、40Y9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。市場は、動意なく閑散。3Mは▲0.31%で少額の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先S/Nは低位横ばいで推移。市場は、一部大型の発行案件が見られたものの、償還総額3,000億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばいでの落ち着いた取引となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/3/24	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.066	0.060	0.010	19,262.53	177.22	110.99-00	111.33-35
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.030						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.145						
2W							-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.314	▲ 0.154						
6M							▲ 0.298	▲ 0.198						
1Y							▲ 0.289	▲ 0.222						
									日付	3/16	3/17	3/21	3/22	3/23
									日銀当預残	3,268,300	3,322,200	3,378,000	3,377,800	3,394,000
									準備預金残	2,935,700	2,981,400	3,042,500	3,025,300	3,043,400
									マナタリーベース	4,308,600	4,364,000	4,419,500	4,419,000	4,436,600
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.039%	▲0.042%	▲0.039%	▲0.037%
									コール市場残高	87,500	99,230	94,238	89,716	94,268
									うち無担	68,168	80,195	73,401	69,059	73,282
									うちO/N	46,849	58,819	52,576	47,740	51,986
									うち有担	19,332	19,035	20,837	20,657	20,986

## ●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	案分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	70,813	2017/3/24	2017/3/27		2,905	2,905		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	17,875	2017/3/24	2017/3/27		337	337		▲0.500	▲0.500	
国債売現先	10,000	2017/3/27	2017/4/3		20,601	10,002	▲0.110		▲0.130	92.3

## ●2017年3月27日の予定

*決定会合における主な意見(3月15、16日分)	*2月の企業向けサービス価格指数
--------------------------	------------------

◆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