

# Central Daily Market Report

2017年3月27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27日		2017年3月28日		2017年3月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 400		0	
財政	20,200		5,100		▲ 5,000	
資金過不足	20,500		4,700		▲ 5,000	
<b>金融調節</b>						
	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		▲ 1,300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,000	
E T F買入			600			
国債補完供給	▲ 3,000	3,300	3,000			
当預増減	16,200		7,800		▲ 4,000	
当座預金残高	3,409,100		3,416,900		3,412,900	
準備預金残高	3,047,300					
積み終了先	2,537,900					
超過準備	2,537,900					
非準備預金先	361,800					
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	99.49%	日数	38.71%		

## ●2017年3月27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1兆1,000億円減の254兆4,000億円(当座預金残高は341兆1,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態で▲0.060~▲0.020%の立ち上がりとなった。一巡後は調達サイドが一服し、▲0.075~▲0.030%とやや弱めの出合いが散見された。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/28-3/29)は、▲0.055~▲0.04%程度の出合い。S/N(3/29-3/30)は、▲0.050~▲0.045%程度の出合い。T/N・S/Nとも目立った要因がなく、レートは横ばい圏内での推移となった。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>

現先レートT/Nは低水準で推移。市場に目立った材料はなく閑散な中、1Y物で▲0.285%での少額出合いが見られた程度。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額2,500億円弱に対して、発行総額は1,000億円弱と償還超。一部の電力業態で大型案件は見られたものの、概ね小型案件が中心の比較的閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移。

## ●短期金融市場関連指標

2017/3/27	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.044				-	▲ 0.057	0.055	▲ 0.005	18,985.59	▲ 276.94	110.55-56	110.18-19
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.043						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.152						
2W							-	▲ 0.137						
3W							-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.308	▲ 0.154						
6M							▲ 0.285	▲ 0.198						
1Y							▲ 0.279	▲ 0.222						
									日付	3/17	3/21	3/22	3/23	3/24
									日銀当預残	3,322,200	3,378,000	3,377,800	3,394,000	3,392,900
									準備預金残	2,981,400	3,042,500	3,025,300	3,043,400	3,051,400
									マネタリーベース	4,364,000	4,419,500	4,419,000	4,436,600	4,436,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.042%	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.039%
									コール市場残高	99,230	94,238	89,716	94,268	110,562
									うち無担	80,195	73,401	69,059	73,282	90,763
									うちO/N	58,819	52,576	47,740	51,986	59,350
									うち有担	19,035	20,837	20,657	20,986	19,799

## ●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)	30000	2017/3/27	2017/3/28		2,894	2894		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/3/27	2017/3/28		35	35		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年3月28日の予定

*米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、3/30発行)
*米国3月のCB消費者信頼感指数	

◆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