

Central Daily Market Report

2017年3月28日(火)

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28日		2017年3月29日		2017年3月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 600		▲ 3,000	
財政	6,200		▲ 900		13,000	
資金過不足	5,900		▲ 1,500		10,000	
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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 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			1,000			
E T F買入	600		700			
国債補完供給	▲ 2,200	3,000	2,200			
当預増減	6,800		2,100		10,000	
当座預金残高	3,415,900		3,418,000		3,428,000	
準備預金残高	3,069,700					
積み終了先	2,566,600				3月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,566,600				積数	10,300
非準備預金先	346,200				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	99.54%	日数	41.94%		

●2017年3月28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256兆4,000億円(当座預金残高は341兆7,000億円)。本日の無担O/Nは▲0.04%の寄り付きとなった。その後は邦銀、証券業態で▲0.07~▲0.025%と概ね昨日と横ばい圏の出合いが見られた。ターム物に関しては特段出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/29-3/30)は、▲0.05~▲0.04%程度の出合い。S/N(3/30-3/31)は、▲0.045~▲0.035%程度の出合い。T/N・S/Nとも売り手の資金調達意欲が強く、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、3M物で▲0.275%での少額出合いが見られた程度であった。

<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3,000億円強に対して、発行総額は2,000億円弱と償還超。一部の電気機器・小売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やや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した。本日はCP等買入オファーが6,000億円オファーされた。応札額が13,267億円と多く、入札結果は平均落札レート▲0.030%・按分落札レート▲0.037%となり、前回(平均▲0.021%・按分▲0.032%)比で若干の低下にとどまった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/28	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.058	0.055	0.000	19,202.87	217.28	110.76-77	110.68-69
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.042						
S/N							-	-						
1W			0.030				-	▲ 0.362						
2W							-	▲ 0.230						
3W							-	▲ 0.169						
1M							-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.291	▲ 0.154						
6M							▲ 0.260	▲ 0.198						
1Y							▲ 0.262	▲ 0.222						
									日付	3/21	3/22	3/23	3/24	3/27
									日銀当預残	3,378,000	3,377,800	3,394,000	3,392,900	3,409,100
									準備預金残	3,042,500	3,025,300	3,043,400	3,051,400	3,047,300
									マネタリーベース	4,419,500	4,419,000	4,436,600	4,436,200	4,452,100
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.039%	▲0.037%	▲0.039%	▲0.044%
									コール市場残高	94,238	89,716	94,268	110,562	102,377
									うち無担	73,401	69,059	73,282	90,763	81,674
									うちO/N	52,576	47,740	51,986	59,350	49,453
									うち有担	20,837	20,657	20,986	19,799	20,703

●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)
流動性供給	234	-	5,000	2017/3/30	-	14,797.0	4,986.0		0.0030%	30.7692%		0.0000%	

●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
CP等買入	6,000	2017/3/31			13,267	5,995	▲0.037		▲0.030	70.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,876	2017/3/28	2017/3/29		2,160	2,160		▲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	2017/3/28	2017/3/29		10	10		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/3/30	2017/4/6	1.36	550	550				

●2017年3月29日の予定

*2月の商業動態統計速報

◆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お客様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