

# Central Daily Market Report

2017年3月29日(水)

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29日		2017年3月30日		2017年3月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 2,300		21,700		11,400	
資金過不足	▲ 2,800		20,600		9,400	
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					11,300	
CP等買入		▲ 300		▲ 1,000	6,000	
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	700		600			
国債補完供給	▲ 2,600	2,200		2,600		
当預増減	▲ 1,800		22,800		26,700	
当座預金残高	3,414,100		3,436,900		3,463,600	
準備預金残高	3,073,400					
積み終了先	2,572,600					
超過準備	2,572,600					
非準備預金先	340,700					
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	99.59%	日数	45.16%		

## ●2017年3月29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5,000億円増の256兆9,000億円(当座預金残高は341兆8,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態から▲0.07~▲0.025%の出合いとなった。一巡後は▲0.065~▲0.035%と調整の出合いが見られた程度。ターム物に関しては特段、出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/30-3/31)は、▲0.03~▲0.025%程度の出合い。S/N(3/31-4/3)は、▲0.80~▲0.50%程度で引合いが見られた。S/Nは、期末初の取引となり、売り手の資金調達意欲が弱く、レートは急低下した。SCでは、全体的にオファーが出難く、締まったレベルでの取引となった。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。年度末受け渡しとはなったものの、参加者が少なく閑散中、3M物で▲0.28%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、月末に係る発行となったものの、事業法人による年度末の有利子負債削減の動きが出たことで、償還総額が約3兆円に対して発行総額は5,000億円弱と大幅に償還超となった。発行レートは概ね低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/3/29	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.045	0.050	▲ 0.005	19,217.48	14.61	111.22-24	111.09-11
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.030						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.556						
2W							-	▲ 0.308						
3W							-	▲ 0.213						
1M							-	▲ 0.166						
3M							▲ 0.266	▲ 0.155						
6M							▲ 0.240	▲ 0.198						
1Y							▲ 0.247	▲ 0.222						
									日付	3/22	3/23	3/24	3/27	3/28
									日銀当預残	3,377,800	3,394,000	3,392,900	3,409,100	3,415,900
									準備預金残	3,025,300	3,043,400	3,051,400	3,047,300	3,069,700
									マネタリーベース	4,419,000	4,436,600	4,436,200	4,452,100	4,459,200
									無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.037%	▲0.039%	▲0.044%	▲0.047%
									コール市場残高	89,716	94,268	110,562	102,377	96,656
									うち無担	69,059	73,282	90,763	81,674	77,138
									うちO/N	47,740	51,986	59,350	49,453	53,299
									うち有担	20,657	20,986	19,799	20,703	19,518

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2017/3/31			11,071	3,002	0.008		0.009	65.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2017/3/31			11,131	3,805	0.008		0.010	44.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/3/31			12,789	4,506	0.000		0.002	3.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	66,814	2017/3/29	2017/3/30		2,578	2,578		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年3月30日の予定

*米国10-12月期のGDP確報値	*2年利付国債入札(22,000億円、4/17発行)
-------------------	----------------------------

◆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