

Central Daily Market Report

2017年3月30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30日		2017年3月31日		2017年4月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 400			1,000
財政	21,600		7,000			▲ 8,000
資金過不足	20,500		6,600			▲ 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					3,000	▲ 3,100
国債買現						
国債売現						10,000
国庫短期証買入						
国債買入			11,400			
CP等買入		▲ 1,000	6,000	▲ 8,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)				▲ 300		
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	600		300			
国債補完供給	▲ 4,800	2,600		4,800		
当預増減	17,900		20,700			2,900
当座預金残高	3,432,000		3,452,700			3,455,600
準備預金残高	3,088,600					
積み終了先	2,586,500				3月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,586,500				積数	7,100
非準備預金先	343,400				1日平均	400
積み期間 (3/16~4/15) の所要準備額						2,244,300
準備預金進捗率	実績	99.68%	日数	48.39%		

●2017年3月30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2兆1000億円増の259兆円(当座預金残高は343兆7,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態から▲0.07~▲0.03%の出合いとなった。一巡後も同水準で調整の出合いが見られた程度であった。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(3/31-4/3)は、▲0.80~▲0.45%程度の引合い。S/N(4/3-4/4)は、▲0.085~▲0.065%程度で出合いが見られた。S/Nは、期末初の要因が剥落したことで、レートは急上昇した。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。新年度受け渡しとなったものの、参加者は少なく、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、期明けの発行となり、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は5,000億円強と活況なマーケットとなった。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

2017/3/30	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.044	0.060	0.010	19,063.22	▲ 154.26	111.14-16	111.06-08
T/N	▲ 0.060	0.050	▲ 0.050				-	▲ 0.665						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.103						
3W			0.000				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.238	▲ 0.145						
6M							▲ 0.225	▲ 0.196						
1Y							▲ 0.219	▲ 0.217						
									日付	3/23	3/24	3/27	3/28	3/29
									日銀当預残	3,394,000	3,392,900	3,409,100	3,415,900	3,414,100
									準備預金残	3,043,400	3,051,400	3,047,300	3,069,700	3,073,400
									マナタリベース	4,436,600	4,436,200	4,452,100	4,459,200	4,457,900
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.039%	▲0.044%	▲0.047%	▲0.046%
									コール市場残高	94,268	110,562	102,377	96,656	95,212
									うち無担	73,282	90,763	81,674	77,138	75,824
									うちO/N	51,986	59,350	49,453	53,299	52,548
									うち有担	20,986	19,799	20,703	19,518	19,388

●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)
2年利付国債	375	0.10%	22,000	2017/4/17	2019/4/15	75,868.0	19,882.0	100.6000	▲0.1990%	92.8827%	100.6130	▲0.2060%	2,111.0

●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>	8000	2017/4/3	2017/4/17		2,980	2,980				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	188,871	2017/3/30	2017/3/31		4,691	4,691		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月31日の予定

*2月の完全失業率(市場予想：3.0%) *2月有効求人倍率(市場予想：1.43倍)
 *2月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲1.7%)
 *2月全国・3月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想：全 国(2月)前年同月比(除く生鮮)：+0.2%
 東京都区部(3月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.2%
 *2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+1.2%)
 *2月の住宅着工統計

*米国2月の個人所得・消費支出
 *米国3月のシカゴPM景況感指数
 *英国10-12月期のGDP確報値
 *ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値

◆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