

Central Daily Market Report

2017年3月1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1日		2017年3月2日		2017年3月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,100		0	
財政	▲ 13,300		▲ 47,200		6,000	
資金過不足	▲ 13,900		▲ 48,300		6,000	
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						
国庫短期証買入						
国債買入	9,000				7,500	
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)					5,600	▲ 800
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	1,200		400			
国債補完供給	▲ 100	2,300		100		
当預増減	▲ 2,000		▲ 48,000		18,300	
当座預金残高	3,294,700		3,246,700		3,265,000	
準備預金残高	2,942,400					
積み終了先	2,479,900		3月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,479,900		積数		1,900	
非準備預金先	352,300		1日平均		100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,016,600	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	50.00%		

●2017年3月1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1,000億円増の248兆1,000億円(当座預金残高見込みは、329兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.065~▲0.015%の幅広いレンジでの出合いで始まった。月末要因の剥落により、ビッドサイドが増えたことで、調達レートが若干上昇した。一巡後は調整程度の調達が散見される中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.015%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(3/2-3/3)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(3/3-3/6)は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。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、5Y126~130、10Y343~345、30Y50~52などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は引続き閑散。6M▲0.29%、1Y▲0.44%で少額の出合いが見られた程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は一部の鉄鋼業態から大型案件がみられたものの、総額560億円程度の出合いと閑散だった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/1	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	▲ 0.046				-	▲ 0.093	0.060	0.010	19,393.54	274.55	113.09-11	113.48-49
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.035	▲ 0.016				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.029				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.159						
3M							▲ 0.317	▲ 0.145						
6M							▲ 0.276	▲ 0.201						
1Y							▲ 0.439	▲ 0.218						
									日付	2/22	2/23	2/24	2/27	2/28
									日銀当預残	3,290,900	3,283,400	3,293,100	3,278,400	3,296,700
									準備預金残	2,952,800	2,951,700	2,950,600	2,934,000	2,937,700
									マネタリーベース	4,326,700	4,320,900	4,332,400	4,318,100	4,337,000
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.032%	▲0.033%	▲0.039%	▲0.048%
									コール市場残高	95,384	101,595	100,741	95,568	85,364
									うち無担	75,409	81,835	80,022	75,227	64,931
									うちO/N	52,364	51,690	49,997	51,553	44,814
									うち有担	19,975	19,760	20,719	20,341	20,433

●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	素分率	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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/3/9	2017/9/11	156,010.0	10,500.01		0.0000%	6.7611%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2017/3/3			10,731	3,203	0.000		0.002	51.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2017/3/3			13,404	4,004	0.013		0.014	30.6
国債買入(物価連動債)	250	2017/3/3			980	251	0.090		0.019	91.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,910	2017/3/1	2017/3/2		63	63		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月2日の予定

- *2月のマネタリーベース
- *2月実績/3月見込み財政資金対民間収支
- *ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値
- *国庫短期証券(667回)入札(3か月、44,000億円、3/6発行)
- *10年利付国債入札(24,000億円、3/21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。

◆本資料は何ら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