

Central Daily Market Report

2017年3月2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2日		2017年3月3日		2017年3月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 400			1,000
財政	▲ 47,400		▲ 3,400			▲ 3,000
資金過不足	▲ 48,500		▲ 3,800			▲ 2,000
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					1,700	▲ 1,600
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)			5,600	▲ 2,700		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入	400					
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 48,200		6,300			▲ 1,900
当座預金残高	3,246,500		3,252,800			3,250,900
準備預金残高	2,899,900					
積み終了先	2,439,500				3月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,439,500				積数	1,700
非準備預金先	346,600				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	99.92%	日数	53.57%		

●2017年3月2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4兆2,000億円減の243兆9,000億円(当座預金残高見込みは、324兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.055~▲0.015%の幅広いレンジでの出会いが始まった。財政等要因で大幅な不足日であったことが影響し、昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出会いが見られる中、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%近辺での出会いが見られた。共通担保資金供給オペは2本オファーされ、2W物8,000億円のオファーに対しては1,465億円の落札(期落ち額1,516億円)・3M物5,000億円のオファーに対しては170億円の落札(期落ち額100億円)といずれも札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(3/3-3/6)は、▲0.105~▲0.095%程度の出会い。S/N(3/6-3/7)は、▲0.12~▲0.10%程度の出会い。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3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.33~▲0.32%の強めの出会いが見られたこともあり、平均落札利回▲0.3466%、按分落札利回▲0.3326%と事前予想より強めの結果となった。セカンダリーはショートカバーと思われる買いから一時▲0.50%の出会いも見られたが、買い一巡後の気配は入札水準まで上昇した。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は5日にかかる発行となり、鉄鋼、商社、石油業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,900億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/3/2	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	▲ 0.076	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.094	0.080	0.020	19,564.80	171.26	114.11-13	114.18-19
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.019	0.002	▲ 0.010				-	▲ 0.106						
2W			0.000				-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.018				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.166						
3M							▲ 0.411	▲ 0.145						
6M							▲ 0.284	▲ 0.201						
1Y							▲ 0.440	▲ 0.218						
									日付	2/23	2/24	2/27	2/28	3/1
									日銀当預残	3,283,400	3,293,100	3,278,400	3,296,700	3,294,700
									準備預金残	2,951,700	2,950,600	2,934,000	2,937,700	2,942,400
									マネタリーベース	4,320,900	4,332,400	4,318,100	4,337,000	4,335,700
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.033%	▲0.039%	▲0.048%	▲0.046%
									コール市場残高	101,595	100,741	95,568	85,364	100,298
									うち無担	81,835	80,022	75,227	64,931	79,607
									うちO/N	51,690	49,997	51,553	44,814	56,997
									うち有担	19,760	20,719	20,341	20,433	20,691

●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)
国庫短期証券	667	-	44,000	2017/3/6	2017/6/5	178,908.0	39,766.9	100.0830	▲0.3326%	73.5027%	100.0865	▲0.3466%	4,233.0
10年利付国債	346	0.10%	24,000	2017/3/21	2027/3/20	81,410.0	21,754.00	100.1300	0.0860%	49.6521%	100.1700	0.0820%	2,228.0

●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〉	8,000	2017/3/6	2017/3/21		1,465	1,465				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	5,000	2017/3/6	2017/6/12		170	170				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/3/2	2017/3/3		26	26		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月3日の予定

*1月の完全失業率(市場予想:3.0%) 1月の有効求人倍率(市場予想:1.44倍)	*2月の消費動向調査
*1月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲0.4%)	*3月の日銀当座預金増減要因見込み
*1月全国・2月都区部消費者物価指数(CPI)	*米国2月のISM非製造業景況指数
市場予想:全 国(1月)前年同月比(除く生鮮):+0.0%	
市場予想:東京都区部(2月)前年同月比(除く生鮮):▲0.2%	

◆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