

Central Daily Market Report

2017年3月3日(金)

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3日		2017年3月6日		2017年3月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		1,000		2,000	
財政	▲ 5,000		▲ 4,800		3,000	
資金過不足	▲ 5,300		▲ 3,800		5,000	
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			1,600	▲ 1,600		
国債買現						
国庫短期証買入					2,500	
国債買入	7,500				7,500	
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
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						
ETF買入			300			
国債補完供給	▲ 1,100			1,100		
当預増減	3,700		▲ 3,000		15,000	
当座預金残高	3,250,200		3,247,200		3,262,200	
準備預金残高	2,902,300					
積み終了先	2,443,300		3月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,443,300		積数		1,100	
非準備預金先	347,900		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	99.95%	日数	64.29%		

●2017年3月3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7,000億円増の244兆6,000億円(当座預金残高見込みは、325兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.05~▲0.015%の幅広いレンジでの出会いが始まった。法人税・年金保険料揚げ後の週末の取引ということで、調達ニーズが強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出会いが見られる中、今週の取引を終えた。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。

<レポ市場>

GC T/N(3/6~3/7)は、▲0.15~▲0.13%程度のお合い。S/N(3/7~3/8)は、▲0.20~▲0.15%程度のお合い。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>

現先レートは低下した。アウトライト市場は短国買入オペが2,500億円実施された。マーケット全般が品薄の中で、予想の下限でのオファー額となり、平均利回較差こそ+0.020%となったものの、按分利回較差は▲0.014%と需給を反映した堅調な結果になった。3Mでは▲0.42~▲0.40%のお合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は石油、電機業態からまとまった発行が見られ、総額850億円程度に達した。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

2017/3/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.074	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.097	0.070	▲ 0.010	19,469.17	▲ 95.63	114.34-36	114.26-27
T/N			0.000				-	▲ 0.126						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.129						
2W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.133						
3W							-	▲ 0.135						
1M							-	▲ 0.189						
3M							▲ 0.401	▲ 0.147						
6M							▲ 0.287	▲ 0.201						
1Y							▲ 0.440	▲ 0.218						
									日付	2/24	2/27	2/28	3/1	3/2
									日銀当預残	3,293,100	3,278,400	3,296,700	3,294,700	3,246,500
									準備預金残	2,950,600	2,934,000	2,937,700	2,942,400	2,900,500
									マネタリーベース	4,332,400	4,318,100	4,337,000	4,335,700	4,288,500
									無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.039%	▲0.048%	▲0.046%	▲0.042%
									コール市場残高	100,741	95,568	85,364	100,298	99,095
									うち無担	80,022	75,227	64,931	79,607	77,922
									うちO/N	49,997	51,553	44,814	56,997	55,085
									うち有担	20,719	20,341	20,433	20,691	21,173

●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	棄分率	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
国庫短期証券買入	2,500	2017/3/7			6,132	2,500	▲0.014		0.020	11.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/3/7			9,155	4,507	▲0.003		0.001	23.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/3/7			4,365	2,005	▲0.007		▲0.003	32.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/3/7			3,282	1,003	0.000		0.002	96.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,000	2017/3/3	2017/3/6		1,084	1,084		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,399	2017/3/3	2017/3/6		12	12		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月6日の予定

*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫

◆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