

Central Daily Market Report

2017年3月7日(火)

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7日		2017年3月8日		2017年3月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		300			0
財政	2,000		6,200			4,000
資金過不足	2,700		6,500			4,000
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	2,500					
国債買入	8,000					
CP等買入		▲500		▲200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入			700			
国債補完供給	▲500	600		500		
当預増減	12,800		7,500			4,000
当座預金残高	3,259,100		3,266,600			3,270,600
準備預金残高	2,924,700					
積み終了先	2,465,000				3月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,465,000				積数	700
非準備預金先	334,400				1日平均	100
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						2,020,700
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	71.43%		

●2017年3月7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2兆2,000億円増の246兆3,000億円(当座預金残高見込みは、326兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、邦銀、証券業態による▲0.05~▲0.015%の幅広いレンジでの出合いで始まった。引き続き調達ニーズの強い展開となり、一巡後も朝方と同水準のレンジでの出合いが散見される中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(3/8-3/9)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/N(3/9-3/10)は、▲0.12~▲0.105%程度の出合い。S/Nは引き続き▲0.10%を下回る水準となっているが、徐々にレートは上昇してきている。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、10Y336~345、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の推移。アウトライト市場は、3M▲0.44%で散発的な出合いが見られた程度で動意薄であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏での推移。CP発行市場は案件に乏しく、比較的閑散とした地合いであった。CP等買入オペアは5,000億円でオファーされ、平均落札利回▲0.005%、按分落札利回▲0.009%と、いずれも前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2017/3/7	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲0.080	0.001	▲0.035				-	▲0.099	0.065	▲0.005		19,344.15	▲34.99	113.89-92	113.84-85
T/N			0.000				-	▲0.099							
S/N							-	-							
1W	▲0.012	▲0.010	▲0.011				-	▲0.147							
2W			▲0.015				-	▲0.151							
3W							-	▲0.150							
1M							-	▲0.193							
3M							▲0.406	▲0.156							
6M							▲0.284	▲0.203							
1Y							▲0.448	▲0.223							
										日付	2/28	3/1	3/2	3/3	3/6
										日銀当預残	3,296,700	3,294,700	3,246,500	3,250,200	3,246,300
										準備預金残	2,937,700	2,942,400	2,900,500	2,902,300	2,900,900
										マネタリーベース	4,337,000	4,335,700	4,288,500	4,292,600	4,287,700
										無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.046%	▲0.042%	▲0.037%	▲0.038%
										コール市場残高	85,364	100,298	99,095	99,321	96,885
										うち無担	64,931	79,607	77,922	78,709	77,151
										うちO/N	44,814	56,997	55,085	56,585	55,747
										うち有担	20,433	20,691	21,173	20,612	19,734

●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)
30年利付国債	54	0.80%	8,000	2017/3/21	2047/3/20	22,739.0	7,232.0	99.3000	0.8290%	97.5395%	99.4900	0.8210%	763.0

●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
CP等買入	5,000	2017/3/10			11,020	4,985	▲0.009		▲0.005	87.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,906	2017/3/7	2017/3/8		492	492		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/3/7	2017/3/8		11	11		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/3/9	2017/3/16	1.15	2	2				

●2017年3月8日の予定

*10-12月期のGDP2次速報
(市場予想：前期比年率+1.6%)
*1月の国際収支
*1月の景気動向指数速報
*2月の景気ウォッチャー調査

*米国1月の卸売売上高

*国庫短期証券(668回)入札
(6ヶ月、32,000億円、3/10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