

Central Daily Market Report

2017年3月16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16日		2017年3月17日		2017年3月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,300			0
財政	1,700		5,500			51,000
資金過不足	800		4,200		51,000	
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					3,100	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,400			
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			75,200	▲ 31,700		
被災地支援						
社債等買入				▲ 400		
ETF買入	300					
国債補完供給	▲ 1,500	1,800		1,500		
当預増減	1,200		58,600		52,600	
当座預金残高	3,268,300		3,326,900		3,379,500	
準備預金残高	2,935,700					
積み終了先	1,345,000		3月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	674,500		積数		436,200	
非準備預金先	332,600		1日平均		14,500	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					2,243,400	
準備預金進捗率	実績	80.56%	日数	3.23%		

●2017年3月16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7,000億円減の248兆円4,000億円(当座預金残高は327兆1,000億円)。本日の無担O/N物は▲0.06~▲0.02%のレンジでの立ち上がりとなった。新積み期間に入り、調達姿勢は底堅く、一巡後も▲0.05~▲0.02%で散発的に出合いが見られた。ターム物に関しては月内エンドのショートタームで▲0.015%近辺の出合いが見られた。固定金利方式による共通担保資金供給オベは2W物で8,000億円がオファーされた。結果は3,050億円(期落ち分は1,465億円)の応札で未達となった。

<レポ市場>

GC T/N(3/17-3/21)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(3/21-3/22)は、▲0.085~▲0.080%程度の出合い。S/Nは、国債の大量発行日にあたることからファンディングニーズが強く、レートを切り上げた。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、5Y126~130、10Y336~345、30Y50~53などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。全般的に様子見閑散な中、3Mが▲0.345~▲0.333%、1Yが▲0.29%で出合う等、小幅な動きにとどまった。

<CP市場>

CP市場は、鉄鋼、卸売業態等で、300億円超の大ロットの調達が行われたものの、入札件数は膨らまず、償還総額3,000億円程に対し、発行総額は1,400億円弱にとどまった。発行レートは、期越物を中心に、若干の低下基調となった。

●短期金融市場関連指標

2017/3/16	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.090	0.070	▲ 0.020	19,590.14	12.76	113.38-40	113.22-24
T/N	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.022	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.015	0.030	▲ 0.004				-	▲ 0.369						
3W							-	▲ 0.305						
1M							-	▲ 0.250						
3M							▲ 0.331	▲ 0.165						
6M							▲ 0.298	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.293	▲ 0.223						
									日付	3/9	3/10	3/13	3/14	3/15
									日銀当預残	3,265,200	3,280,200	3,263,700	3,277,400	3,267,100
									準備預金残	2,924,300	2,955,600	2,945,600	2,956,200	2,947,200
									マネタリーベース	4,305,700	4,320,600	4,303,000	4,316,400	4,306,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.027%	▲ 0.029%	▲ 0.048%	▲ 0.053%	▲ 0.046%
									コール市場残高	95,682	96,152	91,626	93,883	93,807
									うち無担	75,232	76,583	70,855	73,699	74,129
									うちO/N	53,927	56,317	48,178	51,034	52,948
									うち有担	20,450	19,569	20,771	20,184	19,678

●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	案分率	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)	貸付レート・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	貸付比率
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8000	2017/3/21	2017/4/3		3,050	3050				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2017/3/16	2017/3/17		1,492	1,492		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月17日の予定

*10-12月期の資金循環統計速報	*米国2月の鉱工業生産・設備稼働率 *米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*流動性供給入札 (2,000億円、3/22発行)
-------------------	--	------------------------------

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。 (2)資産買入れ方針(賛成7反対2)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆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