

Central Daily Market Report

2017年3月21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21日 | | 2017年3月22日 | | 2017年3月23日 | |
|-----------------------|------------|---------|-----------------|-------|------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 300 | | 200 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 54,900 | | ▲ 4,200 | | 3,000 | |
| 資金過不足 | 55,200 | | ▲ 4,000 | | 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 | 3,100 | ▲ 1,500 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | 5,000 | | | |
| 国債買入 | | | | | 11,500 | |
| CP等買入 | | ▲ 1,100 | | ▲ 400 | 5,000 | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | ▲ 100 | | |
| E T F買入 | | | 500 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 4,300 | 4,400 | | 4,300 | | |
| 当預増減 | 55,800 | | 5,300 | | 18,500 | |
| 当座預金残高 | 3,378,000 | | 3,383,300 | | 3,401,800 | |
| 準備預金残高 | 3,043,600 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,531,300 | | 3月22日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 2,524,600 | | 積数 | | 24,400 | |
| 非準備預金先 | 334,400 | | 1日平均 | | 1,000 | |
| 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 | 98.91% | 日数 | | 19.35% | |

●2017年3月21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5,000億円減の253兆9,000億円(当座預金残高は338兆3,000億円)。本日の無担O/N物は邦銀、証券業態で▲0.06~▲0.02%の出会いと、国債の大量償還による余剰日にあたり、やや慎重な立ち上がりとなった。一巡後は▲0.065~▲0.03%で調整の出会いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/22-3/23)は、▲0.07~▲0.065%程度 of 出会い。S/N(3/23-3/24)は、▲0.075~▲0.065%程度 of 出会い。S/Nは投資家の資金調達ニーズから、引き続き比較的高めのレートで推移した。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、5Y129~131、10Y336~346、30Y50~54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T/Nは低水準で推移。市場は材料なく閑散、目立った出会いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。市場は発行案件乏しく閑散。発行レートは横ばい圏で、落ち着いた取引となった。

●短期金融市場関連指標

| 2017/3/21 | 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 | ▲ 0.075 | 0.010 | ▲ 0.042 | | | | - | ▲ 0.088 | 0.060 | ▲ 0.010 | | 19,455.88 | ▲ 65.71 | 112.55-58 | 112.82-84 |
| T/N | | | 0.000 | | | | - | ▲ 0.071 | | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.010 | 0.100 | 0.045 | | | | - | ▲ 0.105 | | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.001 | 0.030 | 0.009 | | | | - | ▲ 0.414 | | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.319 | | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.258 | | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.336 | ▲ 0.166 | | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.300 | ▲ 0.204 | | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.290 | ▲ 0.223 | | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 3/13 | 3/14 | 3/15 | 3/16 | 3/17 | |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,263,700 | 3,277,400 | 3,267,100 | 3,268,300 | 3,322,200 | |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 2,945,600 | 2,956,200 | 2,947,200 | 2,935,700 | 2,981,400 | |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,303,000 | 4,316,400 | 4,306,500 | 4,308,600 | 4,364,000 | |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.048% | ▲ 0.053% | ▲ 0.046% | ▲ 0.043% | ▲ 0.039% | |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 91,626 | 93,883 | 93,807 | 87,500 | 99,230 | |
| | | | | | | | | | うち無担 | 70,855 | 73,699 | 74,129 | 68,168 | 80,195 | |
| | | | | | | | | | うちO/N | 48,178 | 51,034 | 52,948 | 46,849 | 58,819 | |
| | | | | | | | | | うち有担 | 20,771 | 20,184 | 19,678 | 19,332 | 19,035 | |

●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) | 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) | 3,000 | 2017/3/23 | | | 8,329 | 3,002 | 0.001 | | 0.005 | 10.1 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 4,000 | 2017/3/23 | | | 11,923 | 4,001 | ▲ 0.006 | | ▲ 0.004 | 9.2 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,500 | 2017/3/23 | | | 14,387 | 4,507 | ▲ 0.008 | | ▲ 0.007 | 87.8 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 322,729 | 2017/3/21 | 2017/3/22 | | 4,187 | 4,187 | | ▲ 0.500 | ▲ 0.500 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 49,904 | 2017/3/21 | 2017/3/22 | | 21 | 21 | | ▲ 0.500 | ▲ 0.500 | |
| 米ドル資金供給 | | 2017/3/23 | 2017/3/30 | 1.42 | 2 | 2 | | | | |

●2017年3月22日の予定

| | | |
|----------------------------|--------------|----------------------------|
| *布野日銀審議委員、静岡県金融経済懇談会にて講演 | *2月の貿易統計 | *40年利付国債入札(5,000億円、3/24発行) |
| *日銀金融政策決定会合議事要旨(1月30、31日分) | *米国2月の中古住宅販売 | |

◆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