

Central Daily Market Report

2017年3月31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31日		2017年4月3日		2017年4月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		1,300		3,000	
財政	6,600		▲ 3,700		2,000	
資金過不足	6,300		▲ 2,400		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			3,000	▲ 3,100		
国債買現						
国債売現				10,000		
国庫短期証買入						
国債買入	11,400				11,300	
CP等買入	6,000	▲ 8,100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)		▲ 300				
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 24,200	4,800		24,200		
当預増減	▲ 3,800		31,500		16,300	
当座預金残高	3,428,200		3,459,700		3,476,000	
準備預金残高	3,075,600					
積み終了先	2,566,500					
超過準備	2,564,800					
非準備預金先	352,600					
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					2,250,300	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	58.06%		

●2017年3月31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5,000億円増の259兆5,000億円(当座預金残高は345兆3,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態から▲0.085~▲0.035%の出合いとなった。決算期末の取引となり取り手が薄く、レートは弱含みでの推移となった。一巡後は出し手、取り手共に目途をつけた先が多く見られ閑散としていた。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(4/3-4/4)は、▲0.075~▲0.05%程度の引合い。S/N(4/4-4/5)は、▲0.06~▲0.05%程度で出合いが見られた。S/Nは、目立った要因がなかったことから横ばい圏内で推移した。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、40Y9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。日銀が17時に公表する買入方針を控え、様子見姿勢の中、3M物で▲0.22~▲0.20%での少額出合いが散見された。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は案件少なく、発行総額は300億円程度と閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/3/31	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考対値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.520	0.065	0.005	18,909.26	▲ 153.96	111.73-74	111.79-81
T/N			0.000				-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.093						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.107						
1M			0.002				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.196	▲ 0.148						
6M							▲ 0.208	▲ 0.196						
1Y							▲ 0.203	▲ 0.216						
									日付	3/24	3/27	3/28	3/29	3/30
									日銀当預残	3,392,900	3,409,100	3,415,900	3,414,100	3,432,000
									準備預金残	3,051,400	3,047,300	3,069,700	3,073,400	3,088,600
									マネタリーベース	4,436,200	4,452,100	4,459,200	4,457,900	4,476,800
									無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.044%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.046%
									コール市場残高	110,562	102,377	96,656	95,212	94,778
									うち無担	90,763	81,674	77,138	75,824	75,325
									うちO/N	59,350	49,453	53,299	52,548	54,991
									うち有担	19,799	20,703	19,518	19,388	19,453

●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)	募入最低値	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	2017/4/4			9,213	3,007	0.013		0.014	67.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,800	2017/4/4			9,540	3,805	0.008		0.009	83.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/4/4			12,982	4,507	0.006		0.006	67.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	469,228	2017/3/31	2017/4/3		23,286	23,286		▲0.500	▲0.501	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	24,537	2017/3/31	2017/4/3		229	229		▲0.500	▲0.500	

●2017年4月3日の予定

*4月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+14	*米国2月の建設支出 *米国3月のISM 製造業景況指数
---	---------------------------------

今年度も大変お世話になり、ありがとうございました。来年度もよろしくお願ひ申し上げます。

◆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