Central Daily Market Report

2017年2月2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2月2日 需給速報		2017年2月3日 需給予想		2017年2月6日 当社予想	
銀行券	100		100		2,000	
財政	▲ 71,600		5,900		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 71,500		6,000		▲ 23,000	
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						
国債買入			11,700			
CP等買入				▲ 100		
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				
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給	▲ 2,100	1,500		2,100		
当預増減	▲ 72,200		19,800		▲ 23,000	

当座預金残高	3,240,000	3,259,800	3,236,800
準備預金残高	2,896,800		
積み終了先	2,430,400		
超過準備	2,430,400		
非準備預金先	343,200		

2月3日以降の残り所要積立額	
積数	4,900
1日平均	400

積み期間（1/16～2/15）の所要準備額			2,227,300
準備預金進捗率	実績	99.78%	日数 58.06%

●2017年2月2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7兆円減の243兆1,000億円（当座預金残高見込みは324兆3,000億円）。本日の無担O/Nは、信託・証券業態より▲0.075～▲0.065%、地銀業態より▲0.05～▲0.035%での調達で始まった。財政等要因により大幅な不足日となったものの影響は少なく、その後も同レートで散発的な出合いがみられる中、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/3-2/6)は、▲0.11～▲0.10%程度の出合い。S/N(2/6-2/7)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/Nは、TB3M物と10Yの発行日にあたることから投資家、業者のオファーが増加。昨日と比較して浅いマイナスでの出合いとなった。SCでは、5Y126～130、10Y340～345、30Y52などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先T/Nは低水準で推移。市場は、3M物の入札が実施された。WI取引で出合いが見られない中、入札結果は平均落札利回▲0.2709%・按分落札利回▲0.2625%と前回より若干低下しての決着となった。セカンダリーでは3M▲0.300～▲0.285%と堅調な出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。市場は五・十日に係る発行となり、石油・鉄鋼・建設等の幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は2,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは引き続き低位横ばいで推移。

●短期金融市場関連指標

2017/2/2	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.052				－	▲ 0.102
T/N			0.000				－	▲ 0.103
S/N							－	－
1W			▲ 0.030				－	▲ 0.110
2W			0.010				－	▲ 0.111
3W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.015				－	▲ 0.112
1M			0.000				－	▲ 0.120
3M							▲ 0.288	▲ 0.153
6M							▲ 0.307	▲ 0.225
1Y							▲ 0.337	▲ 0.228

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.104	0.014	18,914.58	▲ 233.50	113.28-31	112.84-86

日付	1/26	1/27	1/30	1/31	2/1
日銀当預残	3,301,500	3,304,100	3,288,600	3,318,600	3,312,200
準備預金残	2,944,200	2,948,300	2,947,000	2,965,800	2,961,400
マネタリーベース	4,339,000	4,342,200	4,326,100	4,355,300	4,348,400
無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.051%	▲0.050%	▲0.058%	▲0.054%
コール市場残高	98,517	99,786	98,260	92,873	102,939
うち無担	77,598	78,946	77,219	73,416	82,745
うちO/N	50,823	53,261	50,914	49,746	58,675
うち有担	20,919	20,840	21,041	19,457	20,194

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	661	－	44,300	2017/2/6	2017/5/8	141,962.1	40,454.5	100.0655	**▲0.2625%**	**73.7562%**	100.0676	**▲0.2709%**	3,845.0
10年利付国債	345	0.10%	24,000	2017/2/6	2026/12/20	78,467.0	21,703.00	100.0700	**0.0920%**	**82.4440%**	100.1200	**0.0870%**	2,283.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2017/2/6	2017/2/20		1,590	1,590				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	27,955	2017/2/2	2017/2/3		2,086	2,086		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	8,017	2017/2/2	2017/2/3		31	31		▲0.600	▲0.600	

●2017年2月3日の予定

*金融政策決定会合議事要旨（2016年12月19、20日分）
*2月の日銀銀当座預金増減要因見込み
*米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国1月の雇用統計
*米国1月のISM製造業景況指数
*交付税特別会計借入（10,500億円、2/13借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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