

# Central Daily Market Report

2017年2月3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2月3日		2017年2月6日		2017年2月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		1,500		2,000	
財政	3,600		▲ 31,200		▲ 2,000	
資金過不足	3,900		▲ 29,700		0	
<b>金融調節</b>						
	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					10,000	
国債買入	11,700				12,400	
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
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	100		200			
国債補完供給	▲ 1,800	2,100		1,800		
当預増減	15,900		▲ 28,000		22,400	
当座預金残高	3,255,900		3,227,900		3,250,300	
準備預金残高	2,910,900					
積み終了先	2,444,600				2月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,444,600				積数	3,400
非準備預金先	345,000				1日平均	300
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	99.85%	日数	67.74%		

## ●2017年2月3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1兆9,000億円増の245兆円(当座預金残高見込みは326兆円)。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▲0.055~▲0.035%での調達で始まった。週末であったが、昨日までと比べ大きな変化は無く、一巡後は散發的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1W~1M物で数件の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/6-2/7)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/7-2/8)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは短国オペア要因から若干レートを下げた出合いとなった。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>

現先レートT/Nは低水準で推移。アウトライト市場は、短国買入オペアが1兆円で実施された。通知後に3M物が▲0.28%まで売られた影響からか、平均落札利回較差+0.013%、按分落札利回較差+0.011%と小甘い結果となった。3M物は▲0.288~▲0.275%の出合いがみられた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。市場は、償還総額1,500億円程度に対し、発行総額は1,100億円程度にとどまった。ノンバンク業態から大型の発行案件が見られたものの落ち着いた取引で、発行レートは横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.099	0.095	▲ 0.009	18,918.20	3.62	112.79-81	113.11-13
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.100	0.025				-	▲ 0.109						
2W							-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.112						
1M	▲ 0.048	▲ 0.005	▲ 0.029				-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.287	▲ 0.153						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.335	▲ 0.228						
									日付	1/27	1/30	1/31	2/1	2/2
									日銀当預残	3,304,100	3,288,600	3,318,600	3,312,200	3,240,000
									準備預金残	2,948,300	2,947,000	2,965,800	2,961,400	2,897,000
									マネタリーベース	4,342,200	4,326,100	4,355,300	4,348,400	4,276,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.050%	▲ 0.058%	▲ 0.054%	▲ 0.052%
									コール市場残高	99,786	98,260	92,873	102,939	95,390
									うち無担	78,946	77,219	73,416	82,745	75,262
									うちO/N	53,261	50,914	49,746	58,675	52,032
									うち有担	20,840	21,041	19,457	20,194	20,128

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/2/13	2017/8/14	122,801.0	10,500.05		0.0000%	8.5891%		0.0000%	

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2017/2/7			23,566	10,003	0.011		0.013	45.7
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/2/7			4,279	700	0.089		0.124	3.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/2/7			16,403	4,504	0.032		0.035	61.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,520	2017/2/3	2017/2/6		1,762	1,762		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	7,030	2017/2/3	2017/2/6		43	43		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)		2017/2/7			7,239	7,239				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.006%。この結果、10年利付国債345回の買入利回りは、0.110%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

## ●2017年2月6日の予定

\*12月の毎月勤労統計調査速報

\*米国1月のFRB労働市場情勢指数

◆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