

# Central Daily Market Report

2017年2月6日(月)

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6日		2017年2月7日		2017年2月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,500		1,000		1,000	
財政	▲ 31,400		5,100		1,000	
資金過不足	▲ 29,900		6,100		2,000	
<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			12,400		7,500	
CP等買入		▲ 300		▲ 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						
E T F買入	200		200			
国債補充供給		1,800				
当預増減	▲ 28,200		28,600		9,500	
当座預金残高	3,227,700		3,256,300		3,265,800	
準備預金残高	2,905,800					
積み終了先	2,443,900					
超過準備	2,443,900					
非準備預金先	321,900					
			2月7日以降の残り所要積立額			
			積数	2,900		
			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	99.87%	日数	70.97%		

## ●2017年2月6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、前営業日比1兆2,000億円減の243兆8,000億円(当座預金残高見込みは322兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.07~▲0.045%、地銀業態より▲0.06~▲0.025%での調達で始まった。積み期間が終盤に入った事で、調達ニーズが強まる展開となり、一巡後も同水準で散発的な出会いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/7-2/8)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/N(2/8-2/9)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内で取引された。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、10Y340~345、30Y52~53、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。市場に目立った材料はなく閑散となり、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は、1,500億円程度の償還に対して、発行額は500億円程度と償還超のマーケットとなった。一部の商社で大型案件が見られたものの、概ね小型案件が中心であった。発行レートに特段の動きは見られなかった。CP等買入オベが前回と同じオファー額3,000億円で実施され、入札結果は平均落札レート▲0.001%・按分落札レート▲0.001%と、前回と同水準の結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/6	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	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.097	0.100	0.005		18,976.71	58.51	112.63-65	112.73-75
T/N							-	▲ 0.093							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.106							
2W			▲ 0.019				-	▲ 0.108							
3W							-	▲ 0.113							
1M							-	▲ 0.118							
3M							▲ 0.284	▲ 0.152							
6M							▲ 0.307	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.334	▲ 0.228							
									日付	1/30	1/31	2/1	2/2	2/3	
									日銀当預残	3,288,600	3,318,600	3,312,200	3,240,000	3,255,900	
									準備預金残	2,947,000	2,965,800	2,961,400	2,897,000	2,910,900	
									マネタリーベース	4,326,100	4,355,300	4,348,400	4,276,100	4,291,700	
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.058%	▲0.054%	▲0.052%	▲0.050%	
									コール市場残高	98,260	92,873	102,939	95,390	107,671	
									うち無担	77,219	73,416	82,745	75,262	87,565	
									うちO/N	50,914	49,746	58,675	52,032	64,125	
									うち有担	21,041	19,457	20,194	20,128	20,106	

## ●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	衆分率	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5年超10年以下)	4,500	2017/2/8			13,093	4,508	0.003		0.005	91.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/2/8			4,182	1,901	0.028		0.033	40.0
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/2/8			3,393	1,105	0.028		0.032	79.5
CP等買入	3,000	2017/2/9			6,787	2,980	▲0.001		▲0.001	65.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	13,676	2017/2/6	2017/2/7		41	41		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年2月7日の予定

*12月の景気動向指数速報	*米国12月の貿易収支	*10年物価連動国債入札(4,000億円、2/9発行)
*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国12月の消費者信用残高	

◆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