

Central Daily Market Report

2017年2月8日(水)

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8日		2017年2月9日		2017年2月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		100		0	
財政	1,700		▲ 8,700		▲ 22,000	
資金過不足	2,400		▲ 8,600		▲ 22,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,500				13,000	
CP等買入		▲ 100	3,000	▲ 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						
ETF買入	200		400			
国債補完供給		200				
当預増減	10,200		▲ 5,500		▲ 9,000	
当座預金残高	3,265,900		3,260,400		3,251,400	
準備預金残高	2,946,500					
積み終了先	2,487,400		2月9日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,487,400		積数	1,800		
非準備預金先	319,400		1日平均	300		
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,246,500	
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数	77.42%		

●2017年2月8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1兆3,000億円増の248兆4,000億円(当座預金残高見込みは326兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.035~▲0.03%、地銀業態より▲0.035~▲0.02%での調達で始まった。昨日に続き調達ニーズは強く、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られるなか本日の取引を終えた。また、一部邦銀から0.001%で試し取りと見られる調達が行われた。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(2/9-2/10)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(2/10-2/13)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、短国発行等の要因があったものの、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。本日は新発6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.25%の出合いが見られる中、減額傾向にある短国買入オペへの慎重姿勢からか、入札結果は平均落札利回▲0.2235%、按分落札利回▲0.1853%と前回比で大きく上昇する結果となった。セカンダリー市場では▲0.205~▲0.20%での出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額500億円弱に対して、発行総額は300億円強と若干の償還超。5・10日発行ではあるものの、案件数自体は少なく、小型案件が中心の閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2017/2/8	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.096	0.090	▲ 0.005	19,007.60	96.82	112.38-40	112.35-37
T/N			0.001				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.101						
2W			0.000				-	▲ 0.107						
3W	▲ 0.025	0.002	▲ 0.018				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.268	▲ 0.153						
6M							▲ 0.202	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.267	▲ 0.228						
									日付	2/1	2/2	2/3	2/6	2/7
									日銀当預残	3,312,200	3,240,000	3,255,900	3,227,700	3,255,700
									準備預金残	2,961,400	2,897,000	2,910,900	2,905,800	2,928,100
									マネタリーベース	4,348,400	4,276,100	4,291,700	4,261,900	4,288,900
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.046%	▲0.035%
									コール市場残高	102,939	95,390	107,671	97,109	96,251
									うち無担	82,745	75,262	87,565	76,451	75,381
									うちO/N	58,675	52,032	64,125	52,981	53,021
									うち有担	20,194	20,128	20,106	20,658	20,870

●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)
国庫短期証券	662	-	32,000	2017/2/10	2017/8/10	93,939.0	28,956.8	100.0920	▲0.1853%	58.3396%	100.1110	▲0.2235%	3,043.0
エネルギー対策	-	-	4,500	2017/2/20	2018/2/20	39,822.0	4,500.00		0.0000%	11.4589%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/2/10			10,552	4,002	0.001		0.003	99.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/2/10			11,179	4,204	▲0.002		▲0.001	70.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/2/10			13,179	4,510	▲0.004		▲0.003	81.6
国債買入(物価連動債)	250	2017/2/10			1,071	251	▲0.110		▲0.168	100.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,711	2017/2/8	2017/2/9		25	25		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月9日の予定

*中菅日銀副総裁、高知県金融経済懇談会にて講演
 *12月の機械受注統計
 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.1%)
 *1月のマネーストック
 *米国12月の卸売売上高

*国庫短期証券(663回)入札
 (3ヶ月、44,000億円、2/13発行)
 *30年利付国債入札
 (8,000億円、2/13発行)

◆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