

# Central Daily Market Report

2017年2月9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9日		2017年2月10日		2017年2月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		0		1,000	
財政	▲ 9,600		▲ 15,300		▲ 18,000	
資金過不足	▲ 9,400		▲ 15,300		▲ 17,000	
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					1,400	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,100			
CP等買入	3,000	▲ 300		▲ 200		
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	400		600			
国債補完供給	▲ 2,400		2,400			
当預増減	▲ 8,700		600		▲ 17,100	
当座預金残高	3,257,200		3,257,800		3,240,700	
準備預金残高	2,933,700					
積み終了先	2,476,600			2月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,476,600			積数	1,300	
非準備預金先	323,500			1日平均	200	
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	99.94%	日数	80.65%		

## ●2017年2月9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2,000億円減の248兆2,000億円(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▲0.035~▲0.025%、地銀業態より▲0.035~▲0.02%での調達で始まった。昨日と同様に、調達ニーズの強い地合いとなったが、一巡後は、ビッド水準がやや低下し、散発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、目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/10-2/13)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/13-2/14)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N・S/Nとも、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、30Y50~52、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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.225~▲0.21%の出合いが見られる中、短国買入への減額傾向による慎重姿勢の強まりからか、入札結果は平均落札利回▲0.2128%、按分落札利回▲0.1904%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3M物で▲0.21~▲0.20%、6M物で▲0.2075~0.20%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100億円弱に対して、発行総額は1,000億円弱と発行超。一部の商社業態で大型案件が見られたものの、概ね小型案件が中心の比較的閑散としたマーケットとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/9	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.095	0.080	▲ 0.010	18,907.67	▲ 99.93	111.96-98	112.34-36
T/N			0.000				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.035	0.002				-	▲ 0.103						
2W			0.000				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.209	▲ 0.153						
6M							▲ 0.202	▲ 0.211						
1Y							▲ 0.233	▲ 0.223						
									日付	2/2	2/3	2/6	2/7	2/8
									日銀当預残	3,240,000	3,255,900	3,227,700	3,255,700	3,265,900
									準備預金残	2,897,000	2,910,900	2,905,800	2,928,100	2,946,600
									マネタリーベース	4,276,100	4,291,700	4,261,900	4,288,900	4,298,300
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.050%	▲0.046%	▲0.035%	▲0.028%
									コール市場残高	95,390	107,671	97,109	96,251	98,079
									うち無担	75,262	87,565	76,451	75,381	77,466
									うちO/N	52,032	64,125	52,981	53,021	54,906
									うち有担	20,128	20,106	20,658	20,870	20,613

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	663	-	43,900	2017/2/13	2017/5/15	144,859.0	39,702.6	100.0475	▲0.1904%	19.5705%	100.0531	▲0.2128%	4,197.0
30年利付国債	53	0.60%	8,000	2017/2/13	2046/12/20	23,390.0	7,232.00	92.5000	0.9200%	19.9288%	92.7700	0.9070%	754.0

## ●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	2017/2/13	2017/2/27		1,430	1,430				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,453	2017/2/9	2017/2/10		2,369	2,369		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/2/9	2017/2/10		8	8		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年2月10日の予定

\*ワシントンにて首脳会談  
\*12月の第3次産業活動指数  
\*1月の企業物価指数

\*米国1月の財政収支  
\*米国2月のミシガン大学、消費者信頼感指数速報

\*交付税特別会計借入(10,500億円、2/23借入)

◆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