

Central Daily Market Report

2017年2月10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10日		2017年2月13日		2017年2月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		900		1,000	
財政	▲ 14,000		▲ 20,400		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 13,900		▲ 19,500		▲ 2,000	
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					15,000	
国債買入	13,100				11,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
E T F買入	600		700			
国債補完供給	▲ 3,700	2,400		3,700		
当預増減	▲ 1,700		▲ 15,400		24,400	
当座預金残高	3,255,500		3,240,100		3,264,500	
準備預金残高	2,932,900					
積み終了先	2,476,000		2月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,475,800		積数		200	
非準備預金先	322,600		1日平均		100	
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	99.99%	日数	90.32%		

●2017年2月10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248兆円(当座預金残高見込みは325兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、信託・証券業態より▲0.035~▲0.02%、地銀業態より▲0.035~▲0.01%での調達で始まった。今積み期最後の週末となった事で、引き続き調達ニーズの強い展開となったが、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(2/13-2/14)は、▲0.08~▲0.06%程度の出合い。S/N(2/14-2/15)は、▲0.085~▲0.07%程度の出合い。T/Nは、短国発行等の要因があったことから、売り手の資金調達意欲が強く、レートは上昇した。S/Nは、短国買入オペ等の要因があったものの、レートの低下は限定的であった。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、10Y343~345、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。短国買入オペが前回比で5,000億円の増額となる1兆5,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.018%、按分落札利回較差+0.002%と、3Mの既発債と6Mの新発債を中心に応札されたと見込まれ、小甘い結果となった。その後の出合いでは、3M物が▲0.225~▲0.21%、6M物が▲0.215~▲0.195%とやや強含みの展開となった。

<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300億円程度に対して、発行総額は1,100億円強と発行超となった。一部の商社・建設業態で大型案件が見られたものの、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

2017/2/10	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	▲ 0.079	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.093	0.080	0.000	19,378.93	471.26	113.44-47	113.83-85
T/N			0.001				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.010	0.005	0.000				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.112						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.216	▲ 0.151						
6M							▲ 0.203	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.217	▲ 0.219						
									日付	2/3	2/6	2/7	2/8	2/9
									日銀当預残	3,255,900	3,227,700	3,255,700	3,265,900	3,257,200
									準備預金残	2,910,900	2,905,800	2,928,100	2,946,600	2,933,700
									マネタリーベース	4,291,700	4,261,900	4,288,900	4,298,300	4,289,400
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.046%	▲0.035%	▲0.028%	▲0.027%
									コール市場残高	107,671	97,109	96,251	98,079	101,911
									うち無担	87,565	76,451	75,381	77,466	81,758
									うちO/N	64,125	52,981	53,021	54,906	51,428
									うち有担	20,106	20,658	20,870	20,613	20,153

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/2/23	2017/8/23	127,192.0	10,500.05		0.0000%	8.2944%		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	15,000	2017/2/14			26,095	15,002	0.002		0.018	88.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/2/14			9,244	4,001	0.005		0.008	56.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/2/14			10,373	4,205	0.012		0.013	45.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/2/14			2,965	2,001	0.007		0.013	20.8
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2017/2/14			3,560	1,206	0.008		0.009	74.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	65,236	2017/2/10	2017/2/13		3,413	3,413		▲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	2017/2/10	2017/2/13		200	200		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月13日の予定

*10-12月期のGDP1次速報
(市場予想:前期比年率+1.1%)

*12月のマネタリーサーベイ

◆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