

# Central Daily Market Report

2017年2月13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13日		2017年2月14日		2017年2月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		100		0	
財政	▲ 21,000		900		58,000	
資金過不足	▲ 20,400		1,000		58,000	
<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	1,400	▲ 1,500				
国債買現						
国庫短期証買入			15,000			
国債買入			11,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 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	700		600			
国債補完供給	▲ 5,400	3,700		5,400		
当預増減	▲ 21,700		33,600		58,000	
当座預金残高	3,233,800		3,267,400		3,325,400	
準備預金残高	2,926,900					
積み終了先	2,470,000		2月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,469,900		積数		100	
非準備預金先	306,900		1日平均		0	
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	100.00%	日数	93.55%		

## ●2017年2月13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246兆8,000億円(当座預金残高見込みは、324兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.035~▲0.02%のレンジでの出合いが始まった。先週末に続き、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低下し、▲0.05~▲0.035%近辺の出合いが見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/14-2/15)は、▲0.09~▲0.06%程度の出合い。S/N(2/15-2/16)は、▲0.08~▲0.07%程度の出合い。T/Nは、ビッドの入りが増えるに伴い、先週末のS/Nの水準からレートを下げたの推移となった。S/Nはオファービッドが離れた目線からの動き出しとなったものの、積最終日の受渡しとなることでビッドサイドの方が薄く、レート水準をやや上げての出合いとなった。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、20y159、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S/N物は引き続き低位で推移した。特段の取引材料が無く、閑散な地合いが続いており、3M物で▲0.225%、6M物で▲0.22%の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。本日のCP発行市場は、五・十日発行に該当し、鉄鋼業態や不動産業態から大型発行が実施されたほか、幅広い業態から発行があり、発行総額は2,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは0%近辺での決着となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/13	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.087	0.085	0.005	19,459.15	80.22	113.92-94	113.54-55
T/N			0.000				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.100						
2W							-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.220	▲ 0.151						
6M							▲ 0.213	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.217	▲ 0.219						
									日付	2/6	2/7	2/8	2/9	2/10
									日銀当預残	3,227,700	3,255,700	3,265,900	3,257,200	3,255,500
									準備預金残	2,905,800	2,928,100	2,946,600	2,933,700	2,932,900
									マネタリーベース	4,261,900	4,288,900	4,298,300	4,289,400	4,287,600
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.035%	▲0.028%	▲0.027%	▲0.023%
									コール市場残高	97,109	96,251	98,079	101,911	101,916
									うち無担	76,451	75,381	77,466	81,758	82,100
									うちO/N	52,981	53,021	54,906	51,428	52,433
									うち有担	20,658	20,870	20,613	20,153	19,816

## ●入札結果

名称	回数	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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,000	2017/2/13	2017/2/14		5,357	5,357		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年2月14日の予定

*米国1月の生産者物価指数	*ユーロ圏10-12月期のGDP2次速報	*5年利付国債入札(24,000億円、2/16発行)
	*英国1月の消費者物価指数	

◆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