

# Central Daily Market Report

2017年2月15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15日		2017年2月16日		2017年2月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 700		▲ 2,000	
財政	57,300		▲ 28,900			0
資金過不足	56,800		▲ 29,600		▲ 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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入					12,700	
CP等買入		▲ 1,300		▲ 200	3,000	
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	400		400			
国債補完供給	▲ 7,600	10,100		7,600		
当預増減	58,400		▲ 21,800		13,700	
当座預金残高	3,315,100		3,293,300		3,307,000	
準備預金残高	2,973,500					
積み終了先	2,500,700				2月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,500,700				積数	2,016,100
非準備預金先	341,600				1日平均	72,000
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						2,016,100
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2017年2月15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3兆3,000億円増の251兆8,000億円(当座預金残高見込みは、332兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.015%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。積み最終日の取引ということもあり調達ニーズが強く、邦銀、証券業態による▲0.03~▲0.015%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は調整程度の調達が散見される中、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/16-2/17)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(2/17-2/20)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。T/Nは、昨日と水準変わらずの出合い。S/Nは引き続き資金調達サイドの様子見姿勢が強く、レートをやや下げながらの推移となった。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>

現先レートは引き続き低位で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引で▲0.255~▲0.235%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.2613%、按分落札利回▲0.2513%と事前の予想よりも堅調な結果となった。セカンダリー市場では、▲0.34~▲0.32%と強めの出合いが見られた。このほかに6M物で▲0.24%での出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばいで推移した。CP発行市場は、一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は約900億円にとどまった。発行レートは引き続き0%近辺での取引が見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.079	0.085	▲ 0.005	19,437.98	199.00	114.28-30	114.47-49
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	0.020	▲ 0.013				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.032	0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.219	▲ 0.149						
6M							▲ 0.219	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.339	▲ 0.219						
									日付	2/8	2/9	2/10	2/13	2/14
									日銀当預残	3,265,900	3,257,200	3,255,500	3,233,800	3,256,700
									準備預金残	2,946,600	2,933,700	2,932,900	2,927,400	2,930,000
									マネタリーベース	4,298,300	4,289,400	4,287,600	4,265,300	4,288,100
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.027%	▲0.023%	▲0.027%	▲0.026%
									コール市場残高	98,079	101,911	101,916	93,820	97,806
									うち無担	77,466	81,758	82,100	75,403	77,652
									うちO/N	54,906	51,428	52,433	52,953	54,709
									うち有担	20,613	20,153	19,816	18,417	20,154

## ●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	664	-	25,000	2017/2/20	2018/2/20	110,275.0	22,620.9	100.2520	▲0.2513%	61.4285%	100.2620	▲0.2613%	2,379.0
国有林野借入	-	-	936	2017/2/27	2022/2/25	3,344.0	936.00		0.0010%	50.0000%		0.0010%	

## ●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	2017/2/17			14,656	4,003	▲0.012		▲0.008	3.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/2/17			12,977	4,203	▲0.004		▲0.001	78.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/2/17			13,724	4,501	0.000		0.002	60.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/2/15	2017/2/16		7,492	7,492		▲0.500	▲0.516	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2017/2/15	2017/2/16		50	50		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年2月16日の予定

*米国1月の住宅着工件数	*国庫短期証券(665回)入札 (3ヶ月、44,000億円、2/20発行)	*流動性供給入札 (4,000億円、2/20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