

Central Daily Market Report

2017年2月16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16日		2017年2月17日		2017年2月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,000			0
財政	▲ 30,400		400		▲ 28,000	
資金過不足	▲ 31,100		▲ 600		▲ 28,000	
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					1,500	▲ 1,600
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 200	3,000	▲ 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					
国債補完供給	▲ 300	7,600		300		
当預増減	▲ 23,600		15,300		▲ 28,100	
当座預金残高	3,291,500		3,306,800		3,278,700	
準備預金残高	2,967,800					
積み終了先	2,139,300				2月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	801,900				積数	322,600
非準備預金先	323,700				1日平均	11,900
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	84.00%	日数	3.57%		

●2017年2月16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27,000億円減少の249兆1,000億円(当座預金残高見込みは329兆3,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態から▲0.07~▲0.04%、地銀業態から▲0.04~▲0.035%の調達希望で始まり、▲0.07~▲0.03%のレンジで出合いが見られた。新しい積み期に入ったことからビッドサイドがレート水準を切り下げ、ギブン地合いとなった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。共通担保資金供給オペは、8,000億円(2/20~3/6)オフアールされ、応札額1,516億円(期落ち分1,590億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(2/17-2/20)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/20-2/21)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。T/Nは、昨日と水準変わらずの出合い。S/Nは短国の発行が重なったことで、業者の資金調達ニーズが厚くなり、レートは上昇した。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>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.215~▲0.21%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.2156%、按分落札利回▲0.2024%と堅調な結果となった。セカンダリー市場では、▲0.23%から出合い始め、▲0.247%まで買い進まれた。その他に、6M物で▲0.24%、1Y物で▲0.339~▲0.335%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、五・十日発行に該当し、商社、不動産業態等から大型発行案件があり、償還総額1,100億程度に対して発行総額2,200億円程度と発行超となった。発行レートは概ね0%近辺での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/2/16	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	▲ 0.045				-	▲ 0.088	0.090	0.005	19,347.53	▲ 90.45	114.12-13	113.94-95
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	0.010	▲ 0.045				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.020	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.105						
3W			0.010				-	▲ 0.109						
1M			0.001				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.245	▲ 0.149						
6M							▲ 0.226	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.335	▲ 0.219						
									日付	2/9	2/10	2/13	2/14	2/15
									日銀当預残	3,257,200	3,255,500	3,233,800	3,256,700	3,315,100
									準備預金残	2,933,700	2,932,900	2,927,400	2,930,000	2,973,500
									マネタリーベース	4,289,400	4,287,600	4,265,300	4,288,100	4,346,900
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.023%	▲0.027%	▲0.026%	▲0.026%
									コール市場残高	101,911	101,916	93,820	97,806	97,950
									うち無担	81,758	82,100	75,403	77,652	78,611
									うちO/N	51,428	52,433	52,953	54,709	55,621
									うち有担	20,153	19,816	18,417	20,154	19,339

●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	665	-	44,000	2017/2/20	2017/5/22	153,511.0	39,928.6	100.0505	▲0.2024%	95.5407%	100.0538	▲0.2156%	4,071.0
流動性供給	231	-	4,000	2017/2/20	-	9,271.0	3,996.00		0.0100%	93.6363%		0.0010%	

●オペ結果

種類	オファ額(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	2017/2/20	2017/3/6		1,516	1,516				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファール)	33,835	2017/2/16	2017/2/17		265	265		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月17日の予定

*交付税特別会計借入
(10,500億円、2/28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