

Central Daily Market Report

2017年2月20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20日		2017年2月21日		2017年2月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		▲ 2,000	
財政	▲ 31,000		4,500		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 31,400		4,100		▲ 3,000	
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			10,000			
国債買入			4,500			
CP等買入		▲ 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						
E T F買入	200		100			
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	▲ 31,700		18,800		▲ 3,000	
当座預金残高	3,275,200		3,294,000		3,291,000	
準備預金残高	2,947,500					
積み終了先	2,465,100		2月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,464,400		積数		17,200	
非準備預金先	327,700		1日平均		800	
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	99.15%	日数	17.86%		

●2017年2月20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33,000億円減少の247兆7,000円(当座預金残高見込みは327兆6,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.075~▲0.065%、証券・地銀業態から▲0.045~▲0.03%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。積み前半ということもあり、特段取り急ぐ動きは見られなかった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/21-2/22)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(2/22-2/23)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N、S/Nともにほぼ水準での推移となった。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、低水準で推移。アウトライト市場は材料が少なく、閑散としており、6M物で▲0.245%の出合いがみられた程度であった。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。CP発行市場は、発行案件が少なく、発行総額400億円程度と閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2017/2/20	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	▲ 0.100	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.087	0.090	0.005	19,251.08	16.46	112.91-93	113.12-14
T/N							-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.020	0.007	▲ 0.016				-	▲ 0.108						
3W			0.000				-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.268	▲ 0.149						
6M							▲ 0.231	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.410	▲ 0.219						
									日付	2/13	2/14	2/15	2/16	2/17
									日銀当預残	3,233,800	3,256,700	3,315,100	3,291,500	3,306,900
									準備預金残	2,927,400	2,930,000	2,973,500	2,967,800	2,978,700
									マネタリーベース	4,265,300	4,288,100	4,346,900	4,324,100	4,340,600
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.026%	▲0.026%	▲0.045%	▲0.047%
									コール市場残高	93,820	97,806	97,950	92,149	94,665
									うち無担	75,403	77,652	78,611	71,982	74,611
									うちO/N	52,953	54,709	55,621	50,392	52,551
									うち有担	18,417	20,154	19,339	20,167	20,054

●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)	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)	20,000	2017/2/20	2017/2/21		200	200		▲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	2017/2/20	2017/2/21		63	63		▲0.500	▲0.500	
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)					
被災地金融支援オペ	第70回	2017/2/24	2018/2/23	0	0					
被災地金融支援オペ(熊本)	第9回	2017/2/24	2018/2/23	0	0					

●2017年2月21日の予定

*流動性供給入札 (5,000億円、2/23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