

# Central Daily Market Report

2017年2月21日(火)  
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21日		2017年2月22日		2017年2月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,100		▲ 3,000	
財政	3,500		200		▲ 5,000	
資金過不足	3,000		▲ 900		▲ 8,000	
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	10,000					
国債買入	4,500					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100	800	
E T F買入	100					
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	17,500		▲ 900		▲ 7,200	
当座預金残高	3,292,700		3,291,800		3,284,600	
準備預金残高	2,956,200					
積み終了先	2,483,700		2月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,480,000		積数	11,500		
非準備預金先	336,500		1日平均	500		
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	99.43%	日数	21.43%		

## ●2017年2月21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15,000億円増加の249兆2,000円(当座預金残高見込みは329兆4,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.065~▲0.05%、証券・地銀業態から▲0.04~▲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。調達サイドは前日よりやや強めの印象だった。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(2/22-2/23)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/23-2/24)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。T/N、S/Nともにほぼ同水準での推移。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。アウトライイト市場は動意に乏しく、閑散としており、6M物で▲0.24%が小額出合った程度であった。

### <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、ノンバンク、商社等の業態からまとまった発行がみられ、発行総額1,500億円程度と膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/21	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.089	0.090	0.000	19,381.44	130.36	113.25-28	113.53-54
T/N			0.001				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.106						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.108						
3W	▲ 0.010	0.030	0.004				-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.269	▲ 0.144						
6M							▲ 0.234	▲ 0.202						
1Y							▲ 0.417	▲ 0.218						
									日付	2/14	2/15	2/16	2/17	2/20
									日銀当預残	3,256,700	3,315,100	3,291,500	3,306,900	3,275,200
									準備預金残	2,930,000	2,973,500	2,967,800	2,978,700	2,947,500
									マネタリーベース	4,288,100	4,346,900	4,324,100	4,340,600	4,309,300
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.026%	▲0.045%	▲0.047%	▲0.046%
									コール市場残高	97,806	97,950	92,149	94,665	94,708
									うち無担	77,652	78,611	71,982	74,611	73,526
									うちO/N	54,709	55,621	50,392	52,551	51,046
									うち有担	20,154	19,339	20,167	20,054	21,182

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	棄分率	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)
流動性供給	232	-	5,000	2017/2/23	-	20,576.0	4,975.00		▲0.0030%	39.8718%		▲0.0050%	

## ●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)	30,000	2017/2/21	2017/2/22		147	147		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年2月22日の予定

- \*米国1月の中古住宅販売
- \*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/2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