

Central Daily Market Report

2017年2月22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22日		2017年2月23日		2017年2月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 1,700		▲ 2,000	
財政	100		▲ 5,000		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 1,100		▲ 6,700		▲ 4,000	
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					13,000	
CP等買入		▲ 100		▲ 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		▲ 100	800	▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 700	200		700		
当預増減	▲ 1,800		▲ 5,600		9,000	
当座預金残高	3,290,900		3,285,300		3,294,300	
準備預金残高	2,952,200					
積み終了先	2,483,600		2月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,483,600		積数		9,500	
非準備預金先	338,700		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	99.53%	日数	25.00%		

●2017年2月22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3,000億円減少の248兆9,000億円(当座預金残高見込みは329兆2,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態から▲0.06~▲0.04%、地銀業態から▲0.035~▲0.03%の調達希望で始まり、▲0.07~▲0.025%のレンジで出合いが見られた。積み前半であるものの、前日に続き調達意欲は強く、一部の先ではレートを引き上げての調達も見られた。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(2/23-2/24)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/24-2/27)は、▲0.095~▲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。日銀オペの影響で10Y345回債が出難くなった局面があった。

<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目立った材料がない中、3M物で▲0.28%、6M物で▲0.25%、1Y物で▲0.44~▲0.43%の出合いがみられた。

<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、電気機器等の業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,100億円程度と膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/2/22	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.088	0.080	▲ 0.010	19,379.87	▲ 1.57	113.66-68	113.40-41
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.104						
2W							-	▲ 0.107						
3W	▲ 0.015	0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.111						
1M			0.005				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.269	▲ 0.144						
6M							▲ 0.238	▲ 0.202						
1Y							▲ 0.432	▲ 0.218						
									日付	2/15	2/16	2/17	2/20	2/21
									日銀当預残	3,315,100	3,291,500	3,306,900	3,275,200	3,292,700
									準備預金残	2,973,500	2,967,800	2,978,700	2,947,500	2,956,300
									マネタリーベース	4,346,900	4,324,100	4,340,600	4,309,300	4,327,200
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.045%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.042%
									コール市場残高	97,950	92,149	94,665	94,708	94,057
									うち無担	78,611	71,982	74,611	73,526	73,811
									うちO/N	55,621	50,392	52,551	51,046	50,161
									うち有担	19,339	20,167	20,054	21,182	20,246

●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	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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/3/2	2017/9/4	122,425.0	10,500.08		0.0000%	8.6223%		0.0000%	

●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	2017/2/24			15,479	4,004	▲0.027		▲0.023	13.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/2/24			10,473	4,203	▲0.018		▲0.013	25.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/2/24			12,716	4,505	▲0.012		▲0.009	76.5
国債買入(物価連動債)	250	2017/2/24			883	250	0.070		▲0.007	40.0
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	40,515	2017/2/22	2017/2/23		645	645		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/2/24	2017/3/2	1.14	202	202				

●2017年2月23日の予定

*木内日銀審議委員、山梨県金融経済懇談会にて講演	*英国10-12月期のGDP改定値	*国庫短期証券(666回)入札(3ヶ月、44,000億円、2/27発行)
*月例経済報告		*20年利付国債入札(11,000億円、2/27発行)
*12月の景気動向指数改訂状況		
*1月の企業向けサービス価格指数		

◆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