

# Central Daily Market Report

2017年2月23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23日		2017年2月24日		2017年2月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 1,700			0
財政	▲ 6,300		▲ 600		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 8,100		▲ 2,300		▲ 13,000	
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					1,400	▲ 1,400
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800	▲ 100		▲ 400		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 500	700		500		
当預増減	▲ 7,500		10,000		▲ 13,000	
当座預金残高	3,283,400		3,293,400		3,280,400	
準備預金残高	2,951,500					
積み終了先	2,483,000				2月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,483,000				積数	7,500
非準備預金先	331,900				1日平均	400
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	99.63%	日数	28.57%		

## ●2017年2月23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248兆6,000億円(当座預金残高見込みは328兆5,000億円)。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~▲0.025%の調達希望で始まり、▲0.07~▲0.02%のレンジで出合いが見られた。一部の先から▲0.02%台の調達も見られるなど前日比でやや強めの推移となった。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(2/27~3/13)オファーされ、応札額1,370億円(期落ち分1,430億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/24-2/27)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/27-2/28)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/NはTDB3M物発行の影響で、売りが若干増加した印象であった。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、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T/Nは、低水準で推移。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.265~▲0.25%と事前予想より強めの出合いが見られたことから、結果は平均落札利回▲0.2593%、按分落札利回▲0.2505%(按分比率72.3258%)と、事前予想より強めの決着となった。セカンダリーは▲0.31~▲0.30%と強めに推移した。また、1Y物で▲0.445~▲0.43%の出合いがみられた。

### <CP市場>

現先レートは、低水準で推移。CP市場は、建設・鉄鋼・食品業態等から大型の発行案件がみられ、発行総額は3,800億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き低位横ばい圏での取引となった。CP等買入オペがオファー額3,000億円で実施され、入札結果は平均落札レート▲0.001%・按分落札レート▲0.003%と前回(按分▲0.001%)よりわずかに低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/23	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.089	0.074	▲ 0.006	19,371.46	▲ 8.41	113.40-42	113.24-25
T/N							-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.016				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.306	▲ 0.144						
6M							▲ 0.243	▲ 0.202						
1Y							▲ 0.435	▲ 0.218						
									日付	2/16	2/17	2/20	2/21	2/22
									日銀当預残	3,291,500	3,306,900	3,275,200	3,292,700	3,290,900
									準備預金残	2,967,800	2,978,700	2,947,500	2,956,300	2,952,800
									マネタリーベース	4,324,100	4,340,600	4,309,300	4,327,200	4,326,700
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.042%	▲0.036%
									コール市場残高	92,149	94,665	94,708	94,057	95,384
									うち無担	71,982	74,611	73,526	73,811	75,409
									うちO/N	50,392	52,551	51,046	50,161	52,364
									うち有担	20,167	20,054	21,182	20,246	19,975

## ●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	素分率	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	666	-	44,200	2017/2/27	2017/5/29	155,574.0	40,245.7	100.0625	▲0.2505%	72.3258%	100.0647	▲0.2593%	3,954.0
20年利付国債	159	0.60%	11,000	2017/2/27	2036/12/20	40,237.0	9,936.00	98.7500	0.6710%	84.1181%	98.7900	0.6690%	1,053.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/2/27	2017/3/13		1,370	1,370				
CP等買入	3,000	2017/2/28			5,230	2,990	▲0.003		▲0.001	18.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,000	2017/2/23	2017/2/24		368	368		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	3,294	2017/2/23	2017/2/24		130	130		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年2月24日の予定

\*交付税特別会計借入  
(10,500億円、3/7借入)

\*米国1月の新築一戸建て販売件数

◆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