

Central Daily Market Report

2017年2月24日(金)
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24日		2017年2月27日		2017年2月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 600		▲ 14,100		5,000	
資金過不足	▲ 2,300		▲ 14,500		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			1,400	▲ 1,400		
国債買現						
国庫短期証買入					5,000	
国債買入	13,100				7,700	
CP等買入		▲ 900		▲ 200	3,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 400				
E T F買入			200			
国債補完供給	▲ 300	500		300		
当預増減	9,700		▲ 14,200		19,700	
当座預金残高	3,293,100		3,278,900		3,298,600	
準備預金残高	2,950,400					
積み終了先	2,481,600		2月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,480,100		積数		2,500	
非準備預金先	342,700		1日平均		100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,015,600	
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	39.29%		

●2017年2月24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、前日比横ばいの248兆6,000億円(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・信託業態から▲0.06~▲0.04%、地銀・証券業態から▲0.03~▲0.02%の調達希望で始まり、▲0.07~▲0.01%のレンジで出会いが見られた。週末3日積みということもあって、朝方こそ▲0.02%台まで取り上がる動きとなったが、一巡後は調達サイドが引き気味となる展開となった。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/27-2/28)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/28-3/1)は、▲0.13~▲0.12%程度の出合い。S/Nは月末初の取引にあたり、警戒感から売りが出難く、レートは低下している。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、30Y50~53、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短国買入オベが5,000億円でオファーされた。結果は、平均利回較差+0.031%、按分利回り較差+0.028%(按分比80.4%)と特定の銘柄を中心に落札されたと見られる水準となった。また、前場から3M物で▲0.365~▲0.32%、6M物で▲0.29~▲0.27%と強め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、月末発行となり鉄鋼・電力等の幅広い業態から大型の発行案件がみられたものの、償還総額12,000億円程度に対して発行総額は6,700億円程度にとどまった。発行レートは、一部の期越え銘柄を中心に強めの決着となる案件がみられた。

●短期金融市場関連指標

2017/2/24	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.033				-	▲ 0.089	0.060	▲ 0.014	19,283.54	▲ 87.92	112.69-70	112.72-73
T/N			0.000				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.109						
2W							-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.329	▲ 0.144						
6M							▲ 0.281	▲ 0.202						
1Y							▲ 0.436	▲ 0.218						
									日付	2/17	2/20	2/21	2/22	2/23
									日銀当預残	3,306,900	3,275,200	3,292,700	3,290,900	3,283,400
									準備預金残	2,978,700	2,947,500	2,956,300	2,952,800	2,951,700
									マネタリーベース	4,340,600	4,309,300	4,327,200	4,326,700	4,320,900
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.046%	▲0.042%	▲0.036%	▲0.032%
									コール市場残高	94,665	94,708	94,057	95,384	101,595
									うち無担	74,611	73,526	73,811	75,409	81,835
									うちO/N	52,551	51,046	50,161	52,364	51,690
									うち有担	20,054	21,182	20,246	19,975	19,760

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/3/7	2017/9/7	143,256.0	10,500.07		0.0000%	7.3645%		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
国庫短期証券買入	5,000	2017/2/28			13,816	5,000	0.028		0.031	80.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/2/28			10,062	4,504	▲0.013		▲0.010	25.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/2/28			8,396	2,014	▲0.017		▲0.014	54.3
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2017/2/28			4,266	1,204	▲0.045		▲0.040	73.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	16,741	2017/2/24	2017/2/27		306	306		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月26日の予定

*東京マラソン2017

●2017年2月27日の予定

*1月の米耐久財新規受注

◆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