

Central Daily Market Report

2017年2月28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28日 | | 2017年3月1日 | | 2017年3月2日 | |
|-----------------------|------------|---------|-----------|--------|----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 700 | | ▲ 600 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 8,000 | | ▲ 11,100 | | ▲ 47,000 | |
| 資金過不足 | 7,300 | | ▲ 11,700 | | ▲ 48,000 | |
| 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 | 5,000 | | | | | |
| 国債買入 | 8,500 | | 9,000 | | | |
| CP等買入 | 3,000 | ▲ 3,400 | | ▲ 500 | | |
| 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 | | | | |
| E T F買入 | 200 | | 1,200 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 2,300 | 100 | 2,300 | | | |
| 当預増減 | 18,300 | | 300 | | ▲ 48,000 | |
| 当座預金残高 | 3,296,700 | | 3,297,000 | | 3,249,000 | |
| 準備預金残高 | 2,937,700 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,474,200 | | | | 3月1日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 2,474,100 | | | | 積数 | 2,100 |
| 非準備預金先 | 359,000 | | | | 1日平均 | 100 |
| 積み期間(2/16~3/15)の所要準備額 | | | | | | 2,016,600 |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.90% | 日数 | 46.43% | | |

●2017年2月28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9,000億円増加の248兆円(当座預金残高見込みは329兆9,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.08~▲0.06%、証券業態から▲0.065~▲0.035%、地銀業態から▲0.035~▲0.02%の調達希望で始まり、▲0.08~▲0.015%のレンジで出合いが見られた。月末で様子見の先もあり、調達サイドの厚みが乏しく、ギブン地合いとなった。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(3/1-3/2)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(3/2-3/3)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。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>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は、3M▲0.35%、1Y▲0.44%で少額の出合いが見られた程度で、全般的に閑散だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく閑散であった。

●短期金融市場関連指標

| 2017/2/28 | 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 | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.048 | | | | - | ▲ 0.099 | 0.050 | 0.004 | 19,118.99 | 11.52 | 112.74-75 | 112.30-32 |
| T/N | | | ▲ 0.010 | | | | - | ▲ 0.091 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.012 | 0.002 | ▲ 0.005 | | | | - | ▲ 0.105 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.010 | 0.000 | ▲ 0.005 | | | | - | ▲ 0.106 | | | | | | |
| 3W | | | 0.005 | | | | - | ▲ 0.113 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.050 | | | | - | ▲ 0.144 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.327 | ▲ 0.145 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.281 | ▲ 0.201 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.438 | ▲ 0.218 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 2/21 | 2/22 | 2/23 | 2/24 | 2/27 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,292,700 | 3,290,900 | 3,283,400 | 3,293,100 | 3,278,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 2,956,300 | 2,952,800 | 2,951,700 | 2,950,600 | 2,934,000 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,327,200 | 4,326,700 | 4,320,900 | 4,332,400 | 4,318,100 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.042% | ▲0.036% | ▲0.032% | ▲0.033% | ▲0.039% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 94,057 | 95,384 | 101,595 | 100,741 | 95,568 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 73,811 | 75,409 | 81,835 | 80,022 | 75,227 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 50,161 | 52,364 | 51,690 | 49,997 | 51,553 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 20,246 | 19,975 | 19,760 | 20,719 | 20,341 |

●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) |
|--------|-----|-------|--------|-----------|-----------|----------|----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 2年利付国債 | 374 | 0.10% | 23,000 | 2017/3/15 | 2019/3/15 | 81,966.0 | 20,875.0 | 100.6850 | ▲0.2400% | 39.8913% | 100.7080 | ▲0.2520% | 2,115.0 |

●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 |
|---------------------------|-----------------|-----------|----------|-----------------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 82,835 | 2017/2/28 | 2017/3/1 | | 1,596 | 1,596 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 70,000 | 2017/2/28 | 2017/3/1 | | 645 | 645 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 米ドル資金供給 | | 2017/3/2 | 2017/3/9 | 1.16 | 1 | 1 | | | | |
| 種類 | スタート日 | エンド日 | 貸付利率 | 貸付予定総額(億円・百万ドル) | 貸付先数 | | | | | |
| 成長基盤強化 | 本則第27回 | 2017/3/3 | 2021/3/3 | 0 | 5,249 | 51 | | | | |
| 成長基盤強化 | 本則第15回(借り換え) | 2017/3/3 | 2018/3/2 | 0 | 366 | 33 | | | | |
| 成長基盤強化 | ABL等特別第23期 | 2017/3/6 | 2021/3/5 | 0 | 20 | 4 | | | | |
| 成長基盤強化 | 小口特別第20期 | 2017/3/3 | 2021/3/3 | 0 | 16.29 | 11 | | | | |
| 成長基盤強化 | 小口特別第8期(借り換え) | 2017/3/3 | 2018/3/2 | 0 | 2.78 | 8 | | | | |
| 成長基盤強化 | 米ドル特別第19期 | 2017/3/3 | 2018/3/5 | | 3,994 | 44 | | | | |
| 成長基盤強化 | 米ドル特別第15期(借り換え) | 2017/3/3 | 2018/3/5 | | 220 | 15 | | | | |
| 成長基盤強化 | 米ドル特別第11期(借り換え) | 2017/3/3 | 2018/3/5 | | 9 | 8 | | | | |
| 成長基盤強化 | 米ドル特別第7期(借り換え) | 2017/3/3 | 2018/3/5 | | 1,337 | 23 | | | | |

●2017年3月1日の予定

| | | | |
|--------------------------|------------|------------------|------------------|
| *佐藤日銀審議委員、徳島県金融経済懇談会にて講演 | *米国ページブック | *米国1月の個人所得・消費支出 | *交付税特別会計借入 |
| *10-12月期の法人企業統計調査季報 | *米国1月の建設支出 | *米国2月のISM製造業景況指数 | (10,500億円、3/9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お客様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戴のがあります。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