

# Central Daily Market Report

2017年2月1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1日		2017年2月2日		2017年2月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		100		0	
財政	▲ 5,900		▲ 71,000		3,000	
資金過不足	▲ 5,400		▲ 70,900		3,000	
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					11,200	
CP等買入		▲ 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		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 1,500	600		1,500		
当預増減	▲ 6,400		▲ 69,500		14,200	
当座預金残高	3,312,200		3,242,700		3,256,900	
準備預金残高	2,961,400					
積み終了先	2,494,100		2月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,494,100		積数		5,200	
非準備預金先	350,800		1日平均		400	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,227,300	
準備預金進捗率	実績	99.77%	日数	54.84%		

## ●2017年2月1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2,000億円増の250兆1,000億円(当座預金残高見込みは331兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.08~▲0.065%、地銀業態より▲0.06~▲0.035%での調達で始まった。積み期間後半に入ったものの、相場に大きな変化は無く、一巡後は、散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1W~3W物で出合いが数件見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/2-2/3)は、▲0.145~▲0.095%程度の出合い。S/N(2/3-2/6)は、▲0.125~▲0.12%程度の出合い。S/Nは週末跨ぎの取引にあたることから投資家のオファーが増加、本日T/Nまでと比べてレートの変動は限定的だった。SCでは、5Y126~130、10Y340~345、30Y52などにビッドの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先T/Nは低水準で推移。市場は、様子見姿勢が強い中、3M▲0.2925~▲0.285%での出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。市場は引続き発行案件に乏しく閑散で、発行総額は400億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏の落ち着いた取引となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/1	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.104	0.090	0.009	19,148.08	106.74	112.77-79	113.56-58
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.111						
2W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.111						
3W			▲ 0.050				-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.289	▲ 0.153						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.350	▲ 0.228						
									日付	1/25	1/26	1/27	1/30	1/31
									日銀当預残	3,305,100	3,301,500	3,304,100	3,288,600	3,318,600
									準備預金残	2,954,100	2,944,200	2,948,300	2,947,000	2,965,800
									マネタリーベース	4,342,100	4,339,000	4,342,200	4,326,100	4,355,300
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.051%	▲0.051%	▲0.050%	▲0.058%
									コール市場残高	98,764	98,517	99,786	98,260	92,873
									うち無担	78,831	77,598	78,946	77,219	73,416
									うちO/N	52,936	50,823	53,261	50,914	49,746
									うち有担	19,933	20,919	20,840	21,041	19,457

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/2/9	2017/8/9	135,254.0	10,500.07		0.0000%	7.7918%		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	2017/2/3			9,796	4,000	▲0.011		▲0.008	20.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/2/3			11,593	4,205	▲0.006		▲0.004	13.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/2/3			6,575	1,910	0.005		0.006	85.1
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/2/3			3,737	1,105	▲0.004		▲0.002	19.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	20,000	2017/2/1	2017/2/2		1,467	1,467		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年2月2日の予定

- \*1月のマネタリーベース
- \*1月の消費動向調査
- \*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支
- \*英中銀MPC結果発表
- \*国庫短期証券(661回)入札(3ヶ月、44,000億円、2/6発行)
- \*10年利付国債入札(24,000億円、2/6発行)

◆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