

Central Daily Market Report

2017年2月7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7日		2017年2月8日		2017年2月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		700			0
財政	4,600		600			▲ 6,000
資金過不足	5,700		1,300			▲ 6,000
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	10,000					
国債買入	12,400		7,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						3,000
E T F買入	200		200			
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	28,000		9,100			▲ 3,000
当座預金残高	3,255,700		3,264,800			3,261,800
準備預金残高	2,927,400					
積み終了先	2,468,100				2月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,468,100				積数	2,400
非準備預金先	328,300				1日平均	300
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						2,246,500
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	74.19%		

●2017年2月7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3兆3,000億円増の247兆1,000億円(当座預金残高見込みは325兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託・証券業態より▲0.05~▲0.04%、地銀業態より▲0.05~▲0.02%での調達で始まった。昨日に比べ、調達ニーズは更に強まり、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。また、一部邦銀から0.001%で試し取りと見られる調達が行われた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/8-2/9)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(2/9-2/10)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内で取引された。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、10Y340~345、30Y52~53、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。市場に目立った材料はなく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は、1,000億円強の償還に対して、発行額は800億円程度と若干の償還超のマーケットとなった。一部の商社・石油業態で大型案件が見られたものの、概ね小型案件が中心となった。発行レートに特段の動きは見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2017/2/7	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.095	0.095	▲ 0.005	18,910.78	▲ 65.93	111.81-83	112.11-12
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.101						
2W							-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.277	▲ 0.153						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.327	▲ 0.228						
									日付	1/31	2/1	2/2	2/3	2/6
									日銀当預残	3,318,600	3,312,200	3,240,000	3,255,900	3,227,700
									準備預金残	2,965,800	2,961,400	2,897,000	2,910,900	2,905,800
									マネタリーベース	4,355,300	4,348,400	4,276,100	4,291,700	4,261,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.054%	▲ 0.052%	▲ 0.050%	▲ 0.046%
									コール市場残高	92,873	102,939	95,390	107,671	97,109
									うち無担	73,416	82,745	75,262	87,565	76,451
									うちO/N	49,746	58,675	52,032	64,125	52,981
									うち有担	19,457	20,194	20,128	20,106	20,658

●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	集分率	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)
物価連動10年	21	0.10%	4,000	2017/2/9	2026/3/10	10,426.0	3,999.00	105.1000	▲0.4390%	25.7142%			

●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)	61,024	2017/2/7	2017/2/8		141	141		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/2/9	2017/2/16	1.16	1	1				

●2017年2月8日の予定

- *日銀金融政策決定会合における主な意見(1月30、31日分)
- *12月の特定サービス産業動態統計速報
- *12月の景気ウォッチャー調査
- *国庫短期証券(662回)入札(6ヶ月、32,000億円、2/10発行)
- *エネルギー対策借入(4,500億円、2/20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