

# Central Daily Market Report

2017年2月14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14日		2017年2月15日		2017年2月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 500	▲ 1,000			
財政	300	58,300	▲ 24,000			
資金過不足	400	57,800	▲ 25,000			
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	15,000					
国債買入	11,900					
CP等買入		▲ 300	▲ 1,300			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	600		400			
国債補完供給	▲ 10,100	5,400	10,100			
当預増減	22,900		67,000		▲ 25,000	
当座預金残高	3,256,700		3,323,700		3,298,700	
準備預金残高	2,929,200					
積み終了先	2,470,700			2月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,470,700			積数	0	
非準備預金先	327,500			1日平均	0	
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	100.00%	日数	96.77%		

## ●2017年2月14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1兆7,000億円増の248兆5,000億円(当座預金残高見込みは、326兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、邦銀、証券業態による▲0.035~▲0.02%のレンジでの出合いで始まった。朝方は調達ニーズが強めであったものの、一巡後はビッド水準が低下し、▲0.05~▲0.035%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが数件見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/15-2/16)は、▲0.08~▲0.07%程度の出合い。S/N(2/16-2/17)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。T/Nは、昨日と水準変わらずの出合い。S/Nは新しい積み期間に入ったことで資金調達サイドが様子見姿勢に転じ、レート水準が若干低下した。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、20y159、30Y50~52、40Y9などにビッドの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、3M物で▲0.225~▲0.22%、6M物で▲0.225%の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、商社等から大型発行が実施され、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートに目立った変化は見なかった。また、本日はCP等買入オペが3,000億円で実施された。按分落札レート・平均落札レートともに▲0.001%と、前回と同様の結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/2/14	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.085	0.090	0.005	19,238.98	▲ 220.17	113.68-70	113.55-57
T/N			0.000				-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.095						
2W			▲ 0.023				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.221	▲ 0.149						
6M							▲ 0.215	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.213	▲ 0.219						
									日付	2/7	2/8	2/9	2/10	2/13
									日銀当預残	3,255,700	3,265,900	3,257,200	3,255,500	3,233,800
									準備預金残	2,928,100	2,946,600	2,933,700	2,932,900	2,927,400
									マネタリーベース	4,288,900	4,298,300	4,289,400	4,287,600	4,265,300
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.028%	▲0.027%	▲0.023%	▲0.027%
									コール市場残高	96,251	98,079	101,911	101,916	93,820
									うち無担	75,381	77,466	81,758	82,100	75,403
									うちO/N	53,021	54,906	51,428	52,433	52,953
									うち有担	20,870	20,613	20,153	19,816	18,417

## ●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	棄分率	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)
5年利付国債	130	0.10%	24,000	2017/2/16	2021/12/20	92,622.0	21,746.0	100.9000	▲0.0850%	26.2248%	100.9200	▲0.0890%	2,246.0

## ●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
CP等買入	3,000	2017/2/17			5,375	2,960	▲0.001		▲0.001	86.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	44,875	2017/2/14	2017/2/15		9,988	9,988		▲0.500	▲0.519	
米ドル資金供給		2017/2/16	2017/2/24	1.16	7	7				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2017/2/15	2017/2/27		2	2		▲0.100	▲0.100	

## ●2017年2月15日の予定

\*12月の石油等消費動態統計

\*米国12月の企業在庫  
\*米国1月の消費者物価指数  
\*米国1月の小売売上高  
\*米国1月の鉱工業生産・設備稼働率

\*国庫短期証券(664回)入札(1年、25,000億円、2/20発行)  
\*国有林野借入(936億円、2/27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。

◆本資料は何ら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