

Central Daily Market Report

2017年2月17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17日		2017年2月20日		2017年2月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 400		▲ 1,000	
財政	800		▲ 30,600		3,000	
資金過不足	▲ 300		▲ 31,000		2,000	
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			1,500	▲ 1,600		
国債買現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	12,800				4,200	
CP等買入	3,000	▲ 200		▲ 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						
ETF買入			200			
国債補充供給	▲ 200	300		200		
当預増減	15,400		▲ 31,000		16,200	
当座預金残高	3,306,900		3,275,900		3,292,100	
準備預金残高	2,978,500					
積み終了先	2,493,700		2月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,408,600		積数		28,800	
非準備預金先	328,400		1日平均		1,200	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,016,100	
準備預金進捗率	実績	98.57%	日数	14.29%		

●2017年2月17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19,000億円増加の251兆円(当座預金残高見込みは330兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.07~▲0.065%、証券・地銀業態から▲0.04~▲0.03%の調達希望で始まり、▲0.075~▲0.025%のレンジで出合いが見られた。週末であったものの、新積み期に入って2日目ということもあり、調達ニーズは限定的で、前日から概ね横ばいの動きとなった。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(2/20-2/21)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(2/21-2/22)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。T/Nは、昨日と水準変わらずの出合い。S/Nは日銀の国債・短国買入オペが入ったことでオフアサイドが引き気味となり、レートはやや低下した。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、大きな変動が見られなかった。アウトライト市場は、短国買入オペが10,000億円で実施された。平均利回較差+0.024%、按分利回較差▲0.001%と1Y物の応札が中心となったと見られるが、按分利回較差はマイナスで決着する堅調な結果となった。オペ後は、3M物で▲0.25%から▲0.27%まで、1Y物で▲0.38%から▲0.41%まで買い進まれた。

<CP市場>

現先レートは引き続き低位で推移した。CP発行市場は、商社、小売等から大型の発行案件があったものの、発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは、引き続き0%近辺での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/2/17	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	▲ 0.047				-	▲ 0.086	0.085	▲ 0.005	19,234.62	▲ 112.91	113.32-34	113.42-43
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.268	▲ 0.149						
6M							▲ 0.227	▲ 0.207						
1Y							▲ 0.401	▲ 0.219						
									日付	2/10	2/13	2/14	2/15	2/16
									日銀当預残	3,255,500	3,233,800	3,256,700	3,315,100	3,291,500
									準備預金残	2,932,900	2,927,400	2,930,000	2,973,500	2,967,800
									マネタリーベース	4,287,600	4,265,300	4,288,100	4,346,900	4,324,100
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.027%	▲0.026%	▲0.026%	▲0.045%
									コール市場残高	101,916	93,820	97,806	97,950	92,149
									うち無担	82,100	75,403	77,652	78,611	71,982
									うちO/N	52,433	52,953	54,709	55,621	50,392
									うち有担	19,816	18,417	20,154	19,339	20,167

●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	2017/2/28	2017/8/28	133,896.0	10,500.08		0.0000%	7.8800%		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	10,000	2017/2/21			24,073	10,000	▲0.001		0.024	88.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/2/21			6,860	2,004	▲0.006		▲0.003	38.5
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2017/2/21			3,905	1,201	▲0.003		0.001	21.6
国債買入(変動利付債)	1,000	2017/2/21			4,360	1,003	▲0.200		▲0.228	51.7
社債等買入	750	2017/2/23			1,556	750	▲0.100		▲0.082	90.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/2/17	2017/2/20		229	229		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月20日の予定

*1月の貿易統計	*New York祝日 (Presidents' Day)
----------	----------------------------------

◆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