

Central Daily Market Report

2017年2月27日(月)
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27日		2017年2月28日		2017年3月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 600			0
財政	▲ 14,400		7,600		▲ 10,000	
資金過不足	▲ 14,900		7,000		▲ 10,000	
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	1,400	▲ 1,400				
国債買現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入			8,500		8,900	
CP等買入		▲ 200	3,000	▲ 3,400		
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		200			
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 14,700		20,300		▲ 1,100	
当座預金残高	3,278,400		3,298,700		3,297,600	
準備預金残高	2,933,200					
積み終了先	2,466,100		2月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,466,100		積数	2,300		
非準備預金先	345,200		1日平均	100		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,015,600	
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	42.86%		

●2017年2月27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15,000億円減少の247兆1,000億円(当座預金残高見込みは327兆9,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.08~▲0.06%、地銀・証券業態から▲0.04~▲0.02%の調達希望で始まり、朝方は▲0.05~▲0.02%のレンジで出合いが見られた。一巡後は▲0.08~▲0.07%の出合いも散見された。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(2/28-3/1)は、▲0.13~▲0.10%程度の出合い。S/N(3/1-3/2)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/Nは月末要因が剥落し、前営業日比でレート上昇した。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、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。アウトライ市場は動意に乏しく全般的に閑散な中、3M▲0.355%の出合いが見られた程度だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は食品品業態からまとまった発行が見られ、総額1,700億円程度の出合いに達した。発行レートは、期を越える銘柄に対しては、引き続き積極的な買いが見られた。

●短期金融市場関連指標

2017/2/27	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	▲ 0.039				-	▲ 0.092	0.046	▲ 0.014	19,107.47	▲ 176.07	112.18-21	112.19-22
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.016	0.050	0.006				-	▲ 0.104						
2W			0.000				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.329	▲ 0.144						
6M							▲ 0.282	▲ 0.201						
1Y							▲ 0.438	▲ 0.218						
									日付	2/20	2/21	2/22	2/23	2/24
									日銀当預残	3,275,200	3,292,700	3,290,900	3,283,400	3,293,100
									準備預金残	2,947,500	2,956,300	2,952,800	2,951,700	2,950,600
									マネタリーベース	4,309,300	4,327,200	4,326,700	4,320,900	4,332,400
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.042%	▲0.036%	▲0.032%	▲0.033%
									コール市場残高	94,708	94,057	95,384	101,595	100,741
									うち無担	73,526	73,811	75,409	81,835	80,022
									うちO/N	51,046	50,161	52,364	51,690	49,997
									うち有担	21,182	20,246	19,975	19,760	20,719

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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年以下)	700	2017/3/1			2,703	700	0.077		0.089	74.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/3/1			16,834	4,011	▲0.008		▲0.007	21.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/3/1			18,691	4,204	▲0.006		▲0.005	37.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,610	2017/2/27	2017/2/28		114	114		▲0.500	▲0.500	

●2017年2月28日の予定

*1月の商業動態統計速報	*米国10-12月期のGDP改定値	*2年利付国債入札(23,000億円、3/15発行)
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.3%)	*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
*1月の住宅着工統計	*米国2月のCB消費者信頼感指数	
	*米国2月のシカゴPM景況感指数	

◆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