Central Daily Market Report

2017年1月4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1月4日 需給速報		2017年1月5日 需給予想		2017年1月6日 当社予想	
銀行券	5,600		4,500		4,000	
財政	2,300		▲ 1,000		▲ 24,000	
資金過不足	7,900		3,500		▲ 20,000	
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	1,300	▲ 1,600				
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,400				11,200	
CP等買入				▲ 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						
ＥＴＦ買入	300					
国債補完供給	▲ 500	6,100		500		
当預増減	25,900		3,600		▲ 8,800	

当座預金残高	3,328,300	3,331,900	3,323,100
準備預金残高	2,996,000		
積み終了先	2,510,700	1月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,510,700	積数	1,500
非準備預金先	332,300	1日平均	100
積み期間（12/16～1/15）の所要準備額			2,202,100
準備預金進捗率	実績 99.93%	日数	64.52%

●2017年1月4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、前営業日比3兆2,000億円増の250兆3,000億円(当座預金残高見込みは、332兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.065～▲0.035%の幅広いレンジでの出合いで始まった。年末要因の剥落により、ビッドサイドが増加したため、調達レートが若干上昇した。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/5-1/6)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(1/6-1/10)は、▲0.095～▲0.09%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達が目立ち、まとまった出合いとなった。SCは、個別銘柄では、5y128～130、10y330、333、335、340～345、20y159、30y52などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。アウトライト市場は1Yが▲0.35%、3M▲0.39～▲0.38%の出合いが見られた程度で、全般的に閑散だった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は年始となり案件、金額共に少なく、発行総額は480億円程度と閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2017/1/4	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.051				－	▲ 0.095
T/N							－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	0.005	▲ 0.007				－	▲ 0.099
2W	▲ 0.037	0.000	▲ 0.014				－	▲ 0.100
3W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.040				－	▲ 0.104
1M	▲ 0.035	0.001	▲ 0.023				－	▲ 0.110
3M							▲ 0.368	▲ 0.155
6M							▲ 0.305	▲ 0.225
1Y							▲ 0.310	▲ 0.228

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.061	0.020	19,594.16	479.79	117.64-65	117.98-00

日付	12/26	12/27	12/28	12/29	12/30
日銀当預残	3,315,100	3,326,500	3,322,800	3,309,600	3,302,400
準備預金残	2,977,000	2,995,100	2,995,800	2,986,200	2,955,000
マネタリーベース	4,379,900	4,393,900	4,392,700	4,381,700	4,374,400
無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.048%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.058%
コール市場残高	93,804	102,313	98,652	97,138	82,952
うち無担	75,068	81,326	78,717	76,270	71,150
うち有担	18,736	20,987	19,935	20,868	11,802

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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年超3年以下）	4,000	2017/1/6			7,982	4,001	▲0.010		▲0.006	79.6
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2017/1/6			12,451	4,204	0.006		0.007	46.2
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,900	2017/1/6			4,752	1,906	0.015		0.018	8.8
国債買入（残存期間25年超）	1,100	2017/1/6			3,990	1,105	0.015		0.016	67.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	49,361	2017/1/4	2017/1/5		508	508		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/1/6	2017/1/12	1.16	491	491				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2017/1/5	2017/1/13		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2017年1月5日の予定

*12月のマネタリーベース
*12月実績/1月見込み財政資金対民間収支
*米国12月のISM非製造業景況指数
*国庫短期証券（655回）入札
（3ヶ月、44,000億円、1/10発行）
*10年利付国債入札
（24,000億円、1/10発行）
*交付税借入
（10,500億円、1/13借入）

◆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論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