

Central Daily Market Report

2017年1月5日(木)

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5日		2017年1月6日		2017年1月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	4,300		3,400		5,000	
財政	▲400		▲18,000		▲42,000	
資金過不足	3,900		▲14,600		▲37,000	
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					1,700	▲2,700
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,300			
CP等買入		▲400		▲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						
E T F買入			200			
国債補完供給	▲1,000	500		1,000		
当預増減	3,000		▲2,200		▲38,000	
当座預金残高	3,331,300		3,329,100		3,291,100	
準備預金残高	3,002,500					
積み終了先	2,517,900				1月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,517,900				積数	1,400
非準備預金先	328,800				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	99.94%	日数	67.74%		

●2017年1月5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1兆1,000億円増の251兆4,000億円(当座預金残高見込みは333兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.06~▲0.035%の幅広いレンジでの出会いが始まった。昨日に比べ調達意欲はやや強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出会いが見られる中、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%近辺での出会いが散見された。共通担保資金供給オペは、8,000億円(1/10~1/23)オファーされ、応募額1,650億円(期落ち分2,652億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(1/6-1/10)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(1/10-1/11)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは短国3M物、10年債の発行要因があり、前日比で0.5bp程度レート上昇した。SCは、個別銘柄では、5y 128~130、10y330、333、335、340~345、20y159、30y52などにビッドが多く見られた。10y345はリオープンとなり普通銘柄となった。

<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3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.35%の出合いから始まり▲0.375%まで買い進められたこともあり、平均落札利回▲0.3618%、按分落札利回▲0.3424%と堅調な結果になった。セカンダリーは▲0.362~▲0.359%の出合いと小動きだった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は10日発行となり鉄鋼、石油、商社業態等からまとまった案件が見られ、発行総額は2,700億円程度に膨らんだ。発行レートはマイナスでの出合いは聞かれず、概ね0%近辺での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/1/5	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	▲0.075	0.001	▲0.047				-	▲0.095	0.055	▲0.006	19,520.69	▲73.47	117.12-13	115.94-96
T/N			▲0.035				-	▲0.091						
S/N							-	-						
1W	▲0.035	0.000	▲0.029				-	▲0.099						
2W	▲0.035	0.010	▲0.016				-	▲0.100						
3W							-	▲0.102						
1M			0.000				-	▲0.109						
3M							▲0.360	▲0.154						
6M							▲0.303	▲0.225						
1Y							▲0.308	▲0.228						
									日付	12/27	12/28	12/29	12/30	1/4
									日銀当預残	3,326,500	3,322,800	3,309,600	3,302,400	3,328,300
									準備預金残	2,995,100	2,995,800	2,986,200	2,955,000	2,996,000
									マネタリーベース	4,393,900	4,392,700	4,381,700	4,374,400	4,394,800
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.058%	▲0.051%
									コール市場残高	102,313	98,652	97,138	82,952	91,677
									うち無担	81,326	78,717	76,270	71,150	72,944
									うちO/N	-	-	-	-	47,804
									うち有担	20,987	19,935	20,868	11,802	18,733

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	案分率	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)
国庫短期証券	655	-	43,900	2017/1/10	2017/4/10	131,889.0	39,771.6	100.0845	▲0.3424%	24.6715%	100.0893	▲0.3618%	4,128.0
10年利付国債	345	0.10%	24,000	2017/1/10	2026/12/20	77,811.0	21,654.0	100.4000	0.0590%	12.9527%	100.4300	0.0560%	2,325.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/1/13	2017/7/13	130,320.0	10,500.03		0.0000%	8.0751%		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	応募総額(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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/1/10	2017/1/23		1,650	1,650				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,321	2017/1/5	2017/1/6		949	949		▲0.600	▲0.600	

●2017年1月6日の予定

*1月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国11月の貿易収支	**国庫短期証券(656回)入札
*11月の毎月勤労統計調査速報	*米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫	(6ヶ月、32,000億円、1/11発行)
	*米国12月の雇用統計	

◆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