

Central Daily Market Report

2017年1月6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1月6日		2017年1月10日		2017年1月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,600		4,200		5,000	
財政	▲17,000		▲36,900		▲16,000	
資金過不足	▲13,400		▲32,700		▲11,000	
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				4,800	
CP等買入		▲100		▲600		
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		1,000			
国債補完供給	▲2,200	1,000		2,200		
当預増減	▲3,200		▲31,100		▲6,200	
当座預金残高	3,328,100		3,297,000		3,290,800	
準備預金残高	3,000,400					
積み終了先	2,517,300			1月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,517,300			積数	500	
非準備預金先	327,700			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	99.98%	日数	80.65%		

●2017年1月6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1兆1,000億円増加の252兆5,000億円(当座預金残高見込みは332兆9,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託業態から▲0.07~▲0.06%、証券業態等から▲0.06~▲0.04%、地銀業態から▲0.07~▲0.035%の調達希望で始まった。週末要因により各業態の調達意欲はやや強く、朝方は▲0.055~▲0.035%の出合いが中心。一巡後は▲0.065~▲0.03%のレンジで出合いが散見された。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T/N(1/10-1/11)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(1/11-1/12)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。T/N,S/Nともに投資家の資金調達がしっかりしており、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。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6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.35%の出合いが見られたこともあり、平均落札利回▲0.3501%、按分落札利回▲0.3400%と前日の3M同様に堅調な結果となった。セカンダリーはオベを睨んでか▲0.40~▲0.388%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。発行市場は鉄鋼業態から大型の発行が見られ、総額1,300億円程度に達した。発行レートは引続き0%近辺で推移した。また、本日はCP等買入オベが2,500億円で実施された。前回オベ比で2,000億円の減額となったこともあり、落札レートは平均、按分共に0.000%といずれも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2017/1/6	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	▲0.070	0.001	▲0.042				-	▲0.088	0.050	▲0.005	19,454.33	▲66.36	115.33-35	116.25-27
T/N							-	▲0.087						
S/N							-	-						
1W	▲0.035	0.005	▲0.023				-	▲0.097						
2W			▲0.019				-	▲0.099						
3W							-	▲0.101						
1M							-	▲0.107						
3M							▲0.355	▲0.154						
6M							▲0.397	▲0.225						
1Y							▲0.305	▲0.228						
									日付	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5
									日銀当預残	3,322,800	3,309,600	3,302,400	3,328,300	3,331,300
									準備預金残	2,995,800	2,986,200	2,955,000	2,996,000	3,002,500
									マネタリーベース	4,392,700	4,381,700	4,374,400	4,394,800	4,393,500
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.058%	▲0.051%	▲0.047%
									コール市場残高	98,652	97,138	82,952	91,677	96,692
									うち無担	78,717	76,270	71,150	72,944	77,073
									うちO/N	-	-	-	47,804	50,313
									うち有担	19,935	20,868	11,802	18,733	19,619

●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)
国庫短期証券	656	-	32,000	2017/1/11	2017/7/10	112,839.0	29,111.60	100.1680	▲0.3400%	59.3077%	100.1730	▲0.3501%	2,888.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/1/11			1,903	701	▲0.015		▲0.003	5.9
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,100	2017/1/11			12,288	4,109	▲0.005		▲0.004	67.6
CP等買入	2,500	2017/1/12			8,337	2,488	0.000		0.000	91.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	62,825	2017/1/6	2017/1/10		1,998	1,998		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	7,384	2017/1/6	2017/1/10		200	200		▲0.500	▲0.500	

●2017年1月9日の予定

*成人の日	*米国11月の消費者信用残高 *米国12月のFRB労働市場情勢指数
-------	--------------------------------------

●2017年1月10日の予定

*12月の消費動向調査	*米国11月の卸売売上高
-------------	--------------

◆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お客様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