

Central Daily Market Report

2017年1月10日(火)
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10日		2017年1月11日		2017年1月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	4,300		4,000		3,000	
財政	▲ 37,000		▲ 14,000		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 32,700		▲ 10,000		▲ 13,000	
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					17,500	
国債買入			5,000		8,500	
CP等買入		▲ 600		▲ 200	2,500	
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	1,000		700			
国債補完供給	▲ 200	2,200		200		
当預増減	▲ 31,300		▲ 4,300		15,500	
当座預金残高	3,296,800		3,292,500		3,308,000	
準備預金残高	2,974,000					
積み終了先	2,493,100				1月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,493,100				積数	300
非準備預金先	322,800				1日平均	100
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						2,222,400
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	83.87%		

●2017年1月10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2兆9,000億円減少の249兆6,000億円(当座預金残高見込みは329兆7,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態などから▲0.06~▲0.04%、地銀業態から▲0.06~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。積み最終日を週末に控えて、複数の参加者にやや強めの調達姿勢が見られており、オファーが入った際には積極的にテイクンされる展開となった。朝方は▲0.04~▲0.03%の出合いが中心。一巡後から午後には掛けては、▲0.06~▲0.03%のレンジで散発的な出合いが見られた。ターム物は、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(1/11-1/12)は、▲0.085~▲0.08%程度の出合い。S/N(1/12-1/13)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、短国、国債の買入オペが通知されたが、資金調達サイドがしっかりで前日比0.5bp程度の小幅低下にとどまった。SCは、個別銘柄では、5y128~130、10y330、333、335、340~345、20y159、30y52、30y53などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは概ね横ばいで推移。アウトライト市場は短国買入オペが17,500億円実施された。先週入札が行われた6M物中心の応札と見られ、平均利回較差+0.021%按分利回較差+0.010%と小甘い結果になった。マーケットでは3Mが▲0.355~▲0.350%、6Mが▲0.390%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。発行市場は機械、石油、小売業態からまとまった発行が見られ総額1,200億円程度に達した。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/1/10	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	▲ 0.037				-	▲ 0.087	0.055	0.005	19,301.44	▲ 152.89	115.98-00	115.83-84
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.002	▲ 0.025				-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.350	▲ 0.154						
6M							▲ 0.390	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.303	▲ 0.228						
									日付	12/29	12/30	1/4	1/5	1/6
									日銀当預残	3,309,600	3,302,400	3,328,300	3,331,300	3,328,100
									準備預金残	2,986,200	2,955,000	2,996,000	3,002,500	3,000,400
									マネタリーベース	4,381,700	4,374,400	4,394,800	4,393,500	4,386,600
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.058%	▲0.051%	▲0.047%	▲0.042%
									コール市場残高	97,138	82,952	91,677	96,692	102,586
									うち無担	76,270	71,150	72,944	77,073	82,019
									うちO/N	-	-	47,804	50,313	52,659
									うち有担	20,868	11,802	18,733	19,619	20,567

●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
国庫短期証券買入	17,500	2017/1/12			33,868	17,501	0.010		0.021	60.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/1/12			8,571	4,001	▲0.029		▲0.019	2.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/1/12			15,901	4,203	0.000		0.001	41.5
国債買入(物価連動債)	250	2017/1/12			1,425	252	▲0.320		▲0.373	11.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,607	2017/1/10	2017/1/11		193	193		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/1/12	2017/1/20	1.16	350	350				

●2017年1月11日の予定

*11月の景気動向指数速報	*30年利付国債入札(8,000億円、1/13発行)	*エネルギー対策借入(5,000億円、1/20借入)
*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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