

Central Daily Market Report

2017年1月13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13日		2017年1月16日		2017年1月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,100		2,600		3,000	
財政	▲ 6,700		▲ 39,100		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 4,600		▲ 36,500		0	
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			1,600	▲ 1,500		
国債買現						
国庫短期証買入					15,000	
国債買入			7,400			
CP等買入		▲ 400		▲ 900		
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	100		1,100			
国債補充供給	▲ 900	200		900		
当預増減	▲ 5,600		▲ 27,900		15,000	
当座預金残高	3,309,200		3,281,300		3,296,300	
準備預金残高	2,973,900					
積み終了先	2,497,500		1月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,497,500		積数		2,229,400	
非準備預金先	335,300		1日平均		71,900	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,229,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2017年1月13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4,000億円減少の249兆4,000億円(当座預金残高見込みは331兆円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態などから▲0.03~▲0.02%、地銀業態から▲0.03~▲0.02%近辺の調達希望で始まった。実質的な積み最終日にあたることから、オファーが入った際には積極的にテイクンされ、朝方は▲0.02~▲0.015%での出合いが中心となった。一方で、調整を終えた参加者は早めに取り下がる動きも見られ、一巡後は▲0.06~▲0.03%の幅広いレンジで出合いが見られた。ターム物は、閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(1/16-1/17)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(1/17-1/18)は、▲0.11~▲0.09%程度の出合い。S/Nは売り物が少ない中、短国買入オペが通知された影響で▲0.10%を下回る水準までレートが低下した。SCは、個別銘柄では、5y126、5y128~130、10y330、333、340~345、20y159、30y52、40y9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15,000億円を実施された。平均利回較差+0.022%按分利回較差+0.006%と6M物を中心に応札されたと見られる結果になった。オペ後は3M物で▲0.264%の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は案件、金額共に少なく490億円程度と閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2017/1/13	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.087	0.045	0.005	19,287.28	152.58	114.65-70	114.69-71
T/N							-	▲ 0.096						
S/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007				-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.099						
2W							-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.104						
1M			0.001				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.266	▲ 0.154						
6M							▲ 0.372	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	1/5	1/6	1/10	1/11	1/12
									日銀当預残	3,331,300	3,328,100	3,296,800	3,292,800	3,314,800
									準備預金残	3,002,500	3,000,400	2,974,200	2,969,800	2,972,400
									マネタリーベース	4,393,500	4,386,600	4,351,000	4,342,700	4,361,700
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.042%	▲0.037%	▲0.030%	▲0.027%
									コール市場残高	96,692	102,586	101,413	100,845	100,166
									うち無担	77,073	82,019	81,164	79,913	79,533
									うちO/N	50,313	52,659	52,544	51,773	51,438
									うち有担	19,619	20,567	20,249	20,932	20,633

●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)
流動性供給	229	-	2,000	2017/1/17	-	9,722.0	1,994.0		▲0.0050%	58.2508%		▲0.0130%	
交付税特会	-	-	10,500	2017/1/23	2017/7/24	138,221.0	10,500.05		0.0000%	7.6175%		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	15,000	2017/1/17			30,827	15,001	0.006		0.022	85.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,995	2017/1/13	2017/1/16		698	698		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	60,312	2017/1/13	2017/1/16		131	131		▲0.500	▲0.500	

●2017年1月16日の予定

- *11月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.7%)
- *11月の第3次産業活動指数
- *11月の石油等消費動態統計
- *12月の企業物価指数

*New York祝日
(Martin L. King Jr.'s Day)

◆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