

Central Daily Market Report

2017年1月17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17日		2017年1月18日		2017年1月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,000		1,400		1,000	
財政	1,400		700		▲ 13,000	
資金過不足	3,400		2,100		▲ 12,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入	15,000					
国債買入			12,400			
CP等買入		▲ 400		▲ 200		
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			400			
国債補完供給	▲ 600	2,100		600		
当預増減	19,500		15,300		▲ 12,000	
当座預金残高	3,298,800		3,314,100		3,302,100	
準備預金残高	2,955,600					
積み終了先	2,345,000				1月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,181,200				積数	176,700
非準備預金先	343,200				1日平均	6,100
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	92.07%	日数	6.45%		

●2017年1月17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1兆7,000億円増加の248兆8,000億円(当座預金残高見込みは330兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・地銀勢を中心に▲0.065~▲0.035%の出会い。前日対比で全般的に弱含みの展開であった。一巡後は閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は引き続き、1~2Wの出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/18-1/19)は、▲0.11~▲0.10%程度のお合い。S/N(1/19-1/20)は、▲0.13~▲0.11%程度のお合い。引続きT/N、S/Nともに売り物が少ない中、▲0.10%を下回る水準での取引が中心となった。SCは、個別銘柄では、5y126、5y128~130、10y330、333、340~345、30y52、40y9などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。アウトライト市場は、入札を控えて動意に乏しく、3M▲0.28~0.27%で出会いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は償還300億円程度に対し、発行は650億円強となった。発行レートは概ね横ばい圏での推移。CP等買入オペアが2,500億円オファーされ、平均落札利回0.000%、按分落札利回▲0.001%の結果となり、按分落札利回は前回比で僅かに低下した。

●短期金融市場関連指標

2017/1/17	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	売買参考統計値	平均値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.102	0.045	▲ 0.005	18,813.53	▲ 281.71	114.15-17	113.28-30
T/N			0.000				-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.031				-	▲ 0.113						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.114						
3W			0.000				-	▲ 0.117						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.278	▲ 0.154						
6M							▲ 0.312	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	1/10	1/11	1/12	1/13	1/16
									日銀当預残	3,296,800	3,292,800	3,314,800	3,309,200	3,279,300
									準備預金残	2,974,200	2,969,800	2,972,400	2,973,900	2,946,900
									マネタリーベース	4,351,000	4,342,700	4,361,700	4,354,100	4,321,500
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.030%	▲0.027%	▲0.026%	▲0.047%
									コール市場残高	101,413	100,845	100,166	101,665	93,678
									うち無担	81,164	79,913	79,533	81,685	74,410
									うちO/N	52,544	51,773	51,438	56,240	52,145
									うち有担	20,249	20,932	20,633	19,980	19,268

●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)
20年利付国債	159	0.60%	11,000	2017/1/19	2036/12/20	35,027.0	9,901.00	100.1000	0.5940%	38.2643%	100.1800	0.5890%	1,088.0

●オペ結果

種類	オフター額(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
CP等買入	2,500	2017/1/20			6,225	2,464	▲0.001		0.000	55.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)	28,215	2017/1/17	2017/1/18		585	585		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)	10,000	2017/1/17	2017/1/18		18	18		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第69回 2017/1/20	2018/1/19	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第8回 2017/1/20	2018/1/19	0	164

●2017年1月18日の予定

*米国ページブック	*国庫短期証券(658回)入札 (1年、25,000億円、1/20発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、1/27借入)
*米国12月の消費者物価指数		
*米国12月の鉱工業生産・設備稼働率		
*ユーロ圏12月の消費者物価指数改定値		

◆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