

Central Daily Market Report

2017年1月18日(水)
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18日		2017年1月19日		2017年1月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,400		700			0
財政	1,600		▲ 10,600		▲ 25,000	
資金過不足	3,000		▲ 9,900		▲ 25,000	
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						
国債買入	12,400				7,100	
CP等買入		▲ 200		▲ 200	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					200	
社債等買入						
E T F買入	400		100			
国債補完供給	▲ 5,700	600		5,700		
当預増減	10,500		▲ 4,300		▲ 15,200	
当座預金残高	3,309,300		3,305,000		3,289,800	
準備預金残高	2,966,200					
積み終了先	2,426,900				1月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,395,100				積数	84,100
非準備預金先	343,100				1日平均	3,000
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	96.23%	日数	9.68%		

●2017年1月18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7,000億円増加の249兆5,000億円(当座預金残高見込みは331兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは国内勢を中心に▲0.065~▲0.035%の調達基調で始まった。立ち上がりは前日比で概ね横ばいの▲0.06~▲0.035%の出会い。一巡後は▲0.07~▲0.035%で幅広いレンジでの出会いが見られた。ターム物は一服感により、閑散とした地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(1/19-1/20)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/N(1/20-1/23)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。オファーサイドの資金調達ニーズがやや戻った事で、T/N・S/N共に前日比でレートが上昇した。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>

本日は1Y物の入札が実施された。WI取引で▲0.34%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.335%、按分落札利回▲0.3261%とやや軟調ながらも概ね事前予想通りの結果となった。その後のセカンダリー市場では▲0.4%で少額の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は五・十日発行にあたり、1,400億円の償還に対して、2,500億円弱の発行が見られた。幅広い業態から発行が実施され、石油・電機業態等からは大型案件も実施された。発行レートについては目立った変動は見られず、概ね0%付近での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2017/1/18	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.100	0.050	0.005	18,894.37	80.84	112.88-92	113.32-34
T/N							-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.029	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.111						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.115						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.279	▲ 0.154						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.375	▲ 0.228						
									日付	1/11	1/12	1/13	1/16	1/17
									日銀当預残	3,292,800	3,314,800	3,309,200	3,279,300	3,298,800
									準備預金残	2,969,800	2,972,400	2,973,900	2,946,900	2,955,600
									マネタリーベース	4,342,700	4,361,700	4,354,100	4,321,500	4,339,100
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.027%	▲0.026%	▲0.047%	▲0.048%
									コール市場残高	100,845	100,166	101,665	93,678	95,611
									うち無担	79,913	79,533	81,685	74,410	74,808
									うちO/N	51,773	51,438	56,240	52,145	50,953
									うち有担	20,932	20,633	19,980	19,268	20,803

●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	658	-	25,000	2017/1/20	2018/1/22	96,464.0	22,652.9	100.3290	▲0.3261%	44.7027%	100.3380	▲0.3350%	2,347.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/1/27	2017/7/27	130,205.0	10,500.10		0.0000%	8.0879%		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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/1/20			12,595	4,105	▲0.004		▲0.003	5.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/1/20			5,869	1,908	▲0.005		▲0.001	1.7
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/1/20			4,042	1,103	▲0.008		▲0.006	33.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,610	2017/1/18	2017/1/19		5,614	5,614		▲0.500	▲0.509	
米ドル資金供給		2017/1/20	2017/1/26	1.16	200	200				

●2017年1月19日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(659回)入札(3ヶ月、44,000億円、1/23発行)	*5年利付国債入札(24,000億円、1/23発行)
*米国12月の住宅着工件数		

◆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