

Central Daily Market Report

2017年1月19日(木)

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19日		2017年1月20日		2017年1月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		300		1,000	
財政	▲ 11,500		▲ 22,900		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 10,800		▲ 22,600		▲ 19,000	
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					1,600	▲ 1,700
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,600			
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 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				▲ 100		
E T F買入	100		100			
国債補完供給	▲ 5,600	5,700		5,600		
当預増減	▲ 10,800		▲ 7,200		▲ 19,100	
当座預金残高	3,298,500		3,291,300		3,272,200	
準備預金残高	2,954,900					
積み終了先	2,459,100				1月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,441,000				積数	47,500
非準備預金先	343,600				1日平均	1,800
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	97.87%	日数	12.90%		

●2017年1月19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1兆5,000億円減少の248兆円(当座預金残高見込みは330兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは引き続き横ばい圏の動きで、都銀・信託・地銀・証券を中心に▲0.065~▲0.035%の出会い。一巡後も前日とほぼ横ばいで、▲0.07~▲0.03%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は1~2W物の出会いが複数見られた。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされ、結果は1,571億円(期落ち分1,650億円)の落札で札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(1/20~1/23)は、▲0.10~▲0.09%程度 of 出会い。S/N(1/23~1/24)は、▲0.095~▲0.085%程度 of 出会い。国庫短期証券3M物の発行日の取引となるS/Nは、前日比でレート上昇となった。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。本日は3Mの入札が実施された。WI取引で▲0.29~▲0.285%で出会いが見られ、入札結果は平均落札利回▲0.2861%、按分落札利回▲0.2805%の順調な決着となった。また、1Y物は短国買入オペを睨んでか、一時▲0.45%まで買い進まれる場面も見られた。

<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800億円強の発行が見られ、商社・小売業態から大きめの発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/1/19	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	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.078	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.098	0.070	0.020		19,072.25	177.88	114.71-73	114.82-84
T/N							-	▲ 0.097							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.107							
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.112							
3W							-	▲ 0.114							
1M	▲ 0.020	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.120							
3M							▲ 0.288	▲ 0.154							
6M							▲ 0.307	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.425	▲ 0.228							
									日付	1/12	1/13	1/16	1/17	1/18	
									日銀当預残	3,314,800	3,309,200	3,279,300	3,298,800	3,309,300	
									準備預金残	2,972,400	2,973,900	2,946,900	2,955,600	2,966,600	
									マネタリーベース	4,361,700	4,354,100	4,321,500	4,339,100	4,348,100	
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.026%	▲0.047%	▲0.048%	▲0.047%	
									コール市場残高	100,166	101,665	93,678	95,611	97,091	
									うち無担	79,533	81,685	74,410	74,808	76,242	
									うちO/N	51,438	56,240	52,145	50,953	52,560	
									うち有担	20,633	19,980	19,268	20,803	20,849	

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	案分率	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	659	-	43,500	2017/1/23	2017/4/24	153,218.0	39,497.1	100.0700	▲0.2805%	89.5676%	100.0714	▲0.2861%	4,002.0
5年利付国債	130	0.10%	24,000	2017/1/23	2021/12/20	79,696.0	21,751.00	101.0100	▲0.1040%	84.3636%	101.0700	▲0.1160%	2,247.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/1/23	2017/2/6		1,571	1,571				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	17,918	2017/1/19	2017/1/20		5,469	5,469		▲0.500	▲0.526	

●2017年1月20日の予定

- *中曾日銀副総裁、国際銀行協会にて講演
- *New York祝日(United States presidential inauguration、金融市場は通常通り営業)

◆本資料は信頼できるとさ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