

# Central Daily Market Report

2017年1月23日(月)  
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23日		2017年1月24日		2017年1月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		200		0	
財政	▲ 21,400		▲ 2,500		2,000	
資金過不足	▲ 20,700		▲ 2,300		2,000	
<b>金融調節</b>	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			15,100			
国債買入			11,300		4,800	
CP等買入		▲ 200		▲ 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	700					
国債補完供給		5,700				
当預増減	▲ 14,600		23,900		6,800	
当座預金残高	3,271,400		3,295,300		3,302,100	
準備預金残高	2,951,000					
積み終了先	2,475,000		1月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,473,000		積数	15,200		
非準備預金先	320,400		1日平均	700		
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,229,500	
準備預金進捗率	実績	99.32%	日数	25.81%		

## ●2017年1月23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1兆2,000億円減少の246兆9,000億円(当座預金残高見込みは327兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは週末要因が剥落したことにより若干弱含みの展開で、国内勢を中心に▲0.07~▲0.035%の幅広いレンジでの出合い。一巡後は全般的に閑散で、▲0.07~▲0.03%が散見された程度で本日の取引を終えた。ターム物は出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(1/24-1/25)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(1/25-1/26)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。SCは、個別銘柄では、5Y126・128~130、10Y333・340~345、30Y52、40Y9などにビッドの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先S/N物は引き続き低位で推移した。3Mが▲0.31%、1Yが▲0.435%で少額出合った程度で、動意無く閑散な地合いとなった。

### <CP市場>

CP市場は、五・十日発行に当たり、鉄鋼、化学、卸売業等、複数業態でまとまった額の調達が行われた。償還総額1,200億円弱に対し、発行総額は2,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは、ロットが大きいものも含め、0%近辺の狭いレンジで推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2017/1/23	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	▲ 0.080		0.001	▲ 0.048			-	▲ 0.097	0.050	▲ 0.010	18,891.03	▲ 246.88	113.80-82	113.45-47
T/N							-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.030				-	▲ 0.112						
2W			▲ 0.019				-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.113						
1M			0.001				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.310	▲ 0.153						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.411	▲ 0.228						
									日付	1/16	1/17	1/18	1/19	1/20
									日銀当預残	3,279,300	3,298,800	3,309,300	3,298,500	3,286,000
									準備預金残	2,946,900	2,955,600	2,966,600	2,954,900	2,946,200
									マネタリーベース	4,321,500	4,339,100	4,348,100	4,336,600	4,323,800
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.046%
									コール市場残高	93,678	95,611	97,091	97,354	100,206
									うち無担	74,410	74,808	76,242	76,329	80,439
									うちO/N	52,145	50,953	52,560	50,704	53,209
									うち有担	19,268	20,803	20,849	21,025	19,767

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2017/1/25			3,245	700	0.046		0.053	12.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/1/25			16,298	4,107	▲0.013		▲0.012	73.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	27,918	2017/1/23	2017/1/24		24	24		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年1月24日の予定

\*米国12月の中古住宅販売

\*40年利付国債入札  
(5,000億円、1/26発行)

◆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