

# Central Daily Market Report

2017年1月24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24日		2017年1月25日		2017年1月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		100		▲ 1,000	
財政	▲ 3,400		5,800		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 3,300		5,900		▲ 6,000	
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	15,100					
国債買入	11,300		5,000			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,000	
ETF買入			100			
国債補完供給						
当預増減	22,900		10,600		▲ 5,000	
当座預金残高	3,294,300		3,304,900		3,299,900	
準備預金残高	2,953,300					
積み終了先	2,475,400				1月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,475,400				積数	13,700
非準備預金先	341,000				1日平均	600
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	99.39%	日数	29.03%		

## ●2017年1月24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1兆円増加の247兆9,000億円(当座預金残高見込みは329兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは大手行を中心に調達意欲が弱く、レートは低下基調で、国内勢を中心に▲0.075~▲0.035%の出合い。一巡後は、▲0.08~▲0.075%近辺の出合いが複数散見され、レートは終日低下基調であった。ターム物は本日も閑散で出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(1/25-1/26)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。S/N(1/26-1/27)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。閑散な地合いが続いており、1Yが▲0.44%で少額出合った程度であった。

### <CP市場>

CP市場は、ノンバンクや化学業態等でまとまった額の発行が行われ、償還総額700億円程度に対し、発行総額は1,500億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、一部の最上格銘柄において、マイナス圏での出合いがみられたものの、多くは0%近辺に集中していた。

## ●短期金融市場関連指標

2017/1/24	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.097	0.040	▲ 0.010	18,787.99	▲ 103.04	112.77-80	113.35-38
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.062	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.116						
2W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.310	▲ 0.152						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.409	▲ 0.228						
									日付	1/17	1/18	1/19	1/20	1/23
									日銀当預残	3,298,800	3,309,300	3,298,500	3,286,000	3,271,400
									準備預金残	2,955,600	2,966,600	2,954,900	2,946,200	2,951,000
									マネタリーベース	4,339,100	4,348,100	4,336,600	4,323,800	4,308,600
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.048%
									コール市場残高	95,611	97,091	97,354	100,206	98,870
									うち無担	74,808	76,242	76,329	80,439	79,381
									うちO/N	50,953	52,560	50,704	53,209	52,656
									うち有担	20,803	20,849	21,025	19,767	19,489

## ●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	棄分率	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)
40年利付国債	9	0.40%	5,000	2017/1/26	2056/3/20	14,945.0	4,995.0		0.8650%	15.3846%			

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	7,896	2017/1/24	2017/1/25		53	53		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/1/26	2017/2/2	1.16	122	122				

## ●2017年1月25日の予定

\*12月の貿易統計

\*交付税特別会計借入  
(10,500億円、2/3借入)

◆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