

Central Daily Market Report

2017年1月27日(金)
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27日		2017年1月30日		2017年1月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		700		400	
財政	0		▲ 11,900		▲ 2,300	
資金過不足	▲ 700		▲ 11,200		▲ 1,900	
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			1,500	▲ 1,400		
国債買現						
国庫短期証買入					12,500	
国債買入	3,400				12,700	
CP等買入		▲ 200		▲ 400	3,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F買入	200		200			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	2,600		▲ 11,200		26,300	
当座預金残高	3,304,100		3,292,900		3,319,200	
準備預金残高	2,948,300					
積み終了先	2,474,100		1月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,473,800		積数		6,700	
非準備預金先	355,800		1日平均		400	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,230,200	
準備預金進捗率	実績	99.70%	日数	45.16%		

●2017年1月27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8,000億円増加の247兆7,000億円(当座預金残高見込みは330兆4,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態から▲0.085~▲0.065%、地銀業態から▲0.04~▲0.035%の調達希望で始まった。週末となったものの、引き続き調達ニーズは弱く、前日比横ばいの▲0.08~▲0.035%の出合いが見られた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/30-1/31)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/N(1/31-2/1)は、▲0.25~▲0.19%程度の出合い。S/Nは、月末初取引となることから投資家のオファーが薄く、レートを大幅に切り下げた。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>

現先レートS/Nは同水準で推移した。本日は、短国買入オペがほぼ事前予想通りの1兆2,500億円でオファーされた。平均利回較差こそ+0.007%と小甘くなったが、按分利回較差は▲0.010%と落ち着いた結果であった。応札額は少なめであった。3Mは▲0.29~▲0.275%で出合いが見られるなど、オペ後にレートが小幅低下した。

<CP市場>

CP市場は、月末発行に当たり、幅広い業態で発行案件が膨らみ、活況なマーケットとなった。鉄鋼、陸運業、食料品等複数業態で500億円前後の大ロットでの発行が見られたものの、発行総額は8,000億円程度と、償還総額9,600億円程度を下回った。投資家の買い意欲は強く、期越物中心にマイナス圏での決着も散見された。

●短期金融市場関連指標

2017/1/27	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.096	0.075	▲ 0.010	19,467.40	65.01	114.42-44	115.21-23
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.028	▲ 0.044				-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.119						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.286	▲ 0.152						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.377	▲ 0.228						
									日付	1/20	1/23	1/24	1/25	1/26
									日銀当預残	3,286,000	3,271,400	3,294,300	3,305,100	3,301,500
									準備預金残	2,946,200	2,951,000	2,953,500	2,954,100	2,944,200
									マネタリーベース	4,323,800	4,308,600	4,331,400	4,342,100	4,339,000
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.050%	▲0.049%	▲0.051%
									コール市場残高	100,206	98,870	98,993	98,764	98,517
									うち無担	80,439	79,381	78,376	78,831	77,598
									うちO/N	53,209	52,656	52,551	52,936	50,823
									うち有担	19,767	19,489	20,617	19,933	20,919

●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
国庫短期証券買入	12,500	2017/1/31			22,760	12,502	▲0.010		0.007	41.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/1/31			12,713	4,003	▲0.019		▲0.017	99.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/1/31			9,568	4,202	▲0.012		▲0.009	34.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2017/1/31			16,466	4,503	▲0.018		▲0.017	70.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	26,141	2017/1/27	2017/1/30		58	58		▲0.600	▲0.600	

●2017年1月30日の予定

*日銀金融政策委員会・金融政策決定会合(1日目、31日まで)	*米国12月の個人所得・消費支出	*2年利付国債入札(23,000億円、2/15発行)
*12月の商業動態統計速報		

◆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