

# Central Daily Market Report

2017年1月30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30日		2017年1月31日		2017年2月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		700		1,000	
財政	▲ 15,400		▲ 100		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 14,800		600		▲ 1,000	
<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	1,500	▲ 1,400				
国債買現						
国庫短期証買入			12,500			
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 400	3,000	▲ 1,700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	200		1,400			
国債補完供給	▲ 700	100		700		
当預増減	▲ 15,500		29,200		▲ 1,000	
当座預金残高	3,288,600		3,317,800		3,316,800	
準備預金残高	2,947,000					
積み終了先	2,478,100				1月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,478,100				積数	6,200
非準備預金先	341,600				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	99.72%	日数	48.39%		

## ●2017年1月30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5,000億円減少の247兆2,000億円(当座預金残高見込みは329兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは大手行・証券業態からの▲0.08~▲0.065%、地銀業態より▲0.04~▲0.035%の調達希望で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、立ち上がりは前営業日と横ばい圏の▲0.08~▲0.035%での出会い。一巡後は閑散で本日の取引を終えた。ターム物は1Wの出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(1/31-2/1)は、▲0.25~▲0.15%程度の出会い。S/N(2/1-2/2)は、▲0.095~▲0.09%程度の出会い。T/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、レートが低下しやすかったものの、買いが一巡してからは業者の調整売りから多少レートを切り上げる動きも見られた。SCでは、5Y126~130、10Y340~345、30Y52などにビッドの出入りが多く見られた。

### <短国市場>

現先T/Nは大幅低下。市場は特段の材料も無く閑散。3M▲0.29%で少額の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。償還総額300億程度に対し、鉄鋼・石油・ノンバンク業態から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの動きとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/1/30	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	▲ 0.050				-	▲ 0.095	0.080	0.005	19,368.85	▲ 98.55	114.65-68	114.69-71
T/N							-	▲ 0.174						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.288	▲ 0.152						
6M							▲ 0.307	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.355	▲ 0.228						
									日付	1/23	1/24	1/25	1/26	1/27
									日銀当預残	3,271,400	3,294,300	3,305,100	3,301,500	3,304,100
									準備預金残	2,951,000	2,953,500	2,954,100	2,944,200	2,948,300
									マネタリーベース	4,308,600	4,331,400	4,342,100	4,339,000	4,342,200
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.050%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.051%
									コール市場残高	98,870	98,993	98,764	98,517	99,786
									うち無担	79,381	78,376	78,831	77,598	78,946
									うちO/N	52,656	52,551	52,936	50,823	53,261
									うち有担	19,489	20,617	19,933	20,919	20,840

## ●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)
2年利付国債	373	0.10%	23,000	2017/2/15	2019/2/15	108,645.0	20,944.00	100.5450	▲0.1710%	32.5719%	100.5490	▲0.1730%	2,051.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	49,918	2017/1/30	2017/1/31		643	643		▲0.600	▲0.600	

## ●2017年1月31日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合	*12月の完全失業率(市場予想:3.1%)	*米FOMC(1日目)
*日銀総裁定例会見	*12月の有効求人倍率(市場予想:1.42倍)	*11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*経済・物価情勢の展望	*12月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出・前年比▲0.6%)	*1月の米CB消費者信頼感指数
	*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.3%)	*1月のシコPM景況感指数
	*12月の住宅着工統計	*1月のユーロ圏消費者物価指数速報値
		*10-12月期のユーロ圏GDP1次速報値

◆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