

Central Daily Market Report

2017年1月31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31日 需給速報	2017年2月1日 需給予想	2017年2月2日 当社予想
銀行券	800	500	0
財政	1,200	▲ 3,200	▲ 50,000
資金過不足	2,000	▲ 2,700	▲ 50,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入	12,500		
国債買入	12,800		
CP等買入	3,000	▲ 1,700	▲ 100
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	1,400		
国債補完供給	▲ 600	700	600
当預増減	30,000	▲ 2,200	▲ 50,000
当座預金残高	3,318,600	3,316,400	3,266,400
準備預金残高	2,965,800		
積み終了先	2,497,300	2月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,497,300	積数	5,700
非準備預金先	352,800	1日平均	400
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			2,227,300
準備預金進捗率	実績	99.74%	日数
			51.61%

●2017年1月31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2兆7,000億円増加の249兆9,000億円(当座預金残高見込みは331兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは都銀・信託・証券を中心に▲0.08~▲0.07%、地銀より▲0.05~▲0.035%の調達希望で始まった。月末要因から調達意欲は弱く、レートは低下基調で、立ち上がりは▲0.08~▲0.035%の出会い。一巡後は閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は様子見姿勢から閑散であった。昨日から本日にかけて開催された日銀金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

<レボ市場>

GC T/N(2/1-2/2)は、▲0.12~▲0.095%程度の出会い。S/N(2/2-2/3)は、▲0.15~▲0.095%程度の出会い。T/N、S/N共に月末初要因が剥落したものの、業者の担保確保ニーズから買い進まれる動きが顕著だった。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は引き続き低水準で推移。市場は材料なく閑散。昨日に引き続き、3M▲0.29%での出会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。市場は発行案件に乏しく閑散で、発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/1/31	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レボレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.106
T/N							-	▲ 0.125
S/N							-	-
1W	▲ 0.063	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.110
2W							-	▲ 0.111
3W			0.005				-	▲ 0.114
1M			0.003				-	▲ 0.119
3M							▲ 0.289	▲ 0.153
6M							▲ 0.307	▲ 0.225
1Y							▲ 0.351	▲ 0.228

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.081	0.001	19,041.34	▲ 327.51	113.67-69	113.52-53

日付	1/24	1/25	1/26	1/27	1/30
日銀当預残	3,294,300	3,305,100	3,301,500	3,304,100	3,288,600
準備預金残	2,953,500	2,954,100	2,944,200	2,948,300	2,947,000
マネタリーベース	4,331,400	4,342,100	4,339,000	4,342,200	4,326,100
無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.051%	▲0.050%
コール市場残高	98,993	98,764	98,517	99,786	98,260
うち無担	78,376	78,831	77,598	78,946	77,219
うちO/N	52,551	52,936	50,823	53,261	50,914
うち有担	20,617	19,933	20,919	20,840	21,041

●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	案分率	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)	授分レート ・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	授分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,216	2017/1/31	2017/2/1		549	549		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/2/2	2017/2/9	1.16	0	0				

●2017年2月1日の予定

*米国FOMC(2日目)	*米国1月のISM製造業景況指数	*交付税特別会計借入
*米国12月の建設支出	*米国1月のCB消費者信頼感指数	(10,500億円、2/9借入)

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。
(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2)
短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利：10年物国債金利がゼロ程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。
(2)資産買入れ方針(賛成7反対2)(長期国債以外の資産の買入れについて)
①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。
●また、「貸出増加を支援するための資金供給」、「成長基盤強化を支援するための資金供給」、東日本大震災および熊本地震にかかる「被災地金融機関を支援するための資金供給オペレーション」等の措置について、受付期間を1年間延長することを決定(全員一致)。

◆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