

# Central Daily Market Report

2017年1月20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20日		2017年1月23日		2017年1月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		900		1,000	
財政	▲ 22,400		▲ 21,100		1,000	
資金過不足	▲ 22,200		▲ 20,200		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						
国庫短期証券買入					15,000	
国債買入	7,600				11,200	
CP等買入	2,500	▲ 500		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	200					
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	100		700			
国債補完供給	▲ 5,700	5,600		5,700		
当預増減	▲ 12,500		▲ 14,100		28,200	
当座預金残高	3,286,000		3,271,900		3,300,100	
準備預金残高	2,946,000					
積み終了先	2,464,400		1月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,459,400		積数		18,800	
非準備預金先	340,000		1日平均		800	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					2,229,400	
準備預金進捗率	実績	99.16%	日数	22.58%		

## ●2017年1月20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1,000億円増加の248兆1,000億円(当座預金残高見込みは329兆1,000億円)。週末で3日積みとなることから全般的に慎重な姿勢が見られ、立ち上がりは都銀・信託・地銀・証券を中心に▲0.065~▲0.03%の出合い。一方で、週末要因から一部では若干取りあがる動きも散見された。一巡後は前日とほぼ横ばいの▲0.07~▲0.035%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は1W程度の出合いが複数見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(1/23-1/24)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(1/24-1/25)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/Nは、短国買入オペアがオフアされた事で、前日比でややレートが低下した。SCは、個別銘柄では、5y126、5y128~130、10y333、340~345、30y52、40y9などにビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。短国買入オペアが1兆5,000億円がオフアされた。1Y物を中心に応札されたと見られ、平均落札利回較差+0.016%、按分落札利回較差+0.013%の結果となった。セカンダリー市場では1Y▲0.43~▲0.41%、3M▲0.31~▲0.30%の出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は、償還は限定的だったものの、石油業態からは大型案件も実施され、1,400億円弱の発行となった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/1/20	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.098	0.060	▲ 0.010		19,137.91	65.66	114.93-95	114.79-81
T/N							-	▲ 0.092							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.070	▲ 0.025	▲ 0.043				-	▲ 0.108							
2W							-	▲ 0.112							
3W							-	▲ 0.114							
1M							-	▲ 0.119							
3M							▲ 0.310	▲ 0.153							
6M							▲ 0.307	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.415	▲ 0.228							
									日付	1/13	1/16	1/17	1/18	1/19	
									日銀当預残	3,309,200	3,279,300	3,298,800	3,309,300	3,298,500	
									準備預金残	2,973,900	2,946,900	2,955,600	2,966,600	2,954,900	
									マネタリーベース	4,354,100	4,321,500	4,339,100	4,348,100	4,336,600	
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.047%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.047%	
									コール市場残高	101,665	93,678	95,611	97,091	97,354	
									うち無担	81,685	74,410	74,808	76,242	76,329	
									うちO/N	56,240	52,145	50,953	52,560	50,704	
									うち有担	19,980	19,268	20,803	20,849	21,025	

## ●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	案分率	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)
預借借入(再生)	-	-	210	2017/2/3	2018/1/22	1,532.0	210.00		0.0000%	17.6170%		0.0000%	

## ●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	15,000	2017/1/24			26,969	15,000		0.013	0.016	
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/1/24			10,373	4,003	▲0.012		▲0.009	94.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/1/24			8,362	4,203	▲0.007		▲0.004	15.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/1/24			4,703	1,901	0.025		0.026	92.5
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/1/24			3,510	1,104	0.026		0.027	48.4
社債等買入	1,000	2017/1/26			1,551	1,000	▲0.150		▲0.136	51.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	21,691	2017/1/20	2017/1/23		5,429	5,429		▲0.500	▲0.514	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)	14,619	2017/1/20	2017/1/23		222	222		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年1月23日の予定

- \*月例経済報告
- \*11月の景気動向指数改訂状況

◆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