

Central Daily Market Report

2018年1月4日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2018年1月4日		2018年1月5日		2018年1月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	5,900		4,100		5,000	
財政	▲ 400		▲ 2,400		▲ 25,000	
資金過不足	5,500		1,700		▲ 20,000	
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	3,000	▲ 4,100			2,200	▲ 5,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,100				9,600	
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200	3,900		200		
当増増減	15,100		1,500		▲ 13,400	
当座預金残高	3,701,200		3,702,700		3,689,300	
準備預金残高	3,269,600					
積み終了先	3,269,400		1月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,269,400		積数		1,700	
非準備預金先	431,600		1日平均		200	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,051,200	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	64.52%		

●2018年1月4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、前営業日比7,000億円増の326兆7,000億円(当座預金残高見込みは370兆円)。本日の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態から▲0.065~▲0.045%の幅広いレンジでの調達希望で始まった。年末要因の剥落により、調達意欲は強く、出会いの中心は▲0.055~▲0.04%となった。ターム物は1~2W物を中心に▲0.04%近辺の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/5-1/9)は、▲0.090~▲0.075%程度での出会い。S/N(1/9-1/10)は、▲0.085~▲0.075%程度で出会い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、2Y381~383、5Y130~134、10Y336~349、30Y51~57などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は3M物の入札を控え、様子見閑散。3M物が▲0.162%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は鉄鋼業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は600億円程度にとどまった。発行レートは横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/1/4	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	▲ 0.062	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.089	0.050	0.005	23,506.33	741.39	112.61-62	112.57-59
T/N			0.000				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.085						
3W			0.000				-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.050	0.043	▲ 0.028				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.153	▲ 0.122						
6M							▲ 0.150	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.160						
									日付	12/25	12/26	12/27	12/28	12/29
									日銀当預残	3,695,400	3,696,800	3,696,000	3,689,300	3,686,100
									準備預金残	3,265,600	3,270,100	3,271,000	3,260,300	3,232,400
									マネタリーベース	4,800,800	4,805,000	4,807,200	4,803,700	4,801,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.043%	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.036%	▲ 0.062%
									コール市場残高	106,875	108,207	112,455	102,155	80,591
									うち無担	83,941	85,337	89,702	79,222	58,175
									うちO/N	47,586	49,252	54,057	44,332	43,575
									うち有担	22,934	22,870	22,753	22,933	22,416

●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)	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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/1/9	2018/1/22		2,220	2,220				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/1/9			7,347	2,505	0.000		0.001	38.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/1/9			11,665	3,003	0.003		0.003	68.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/1/9			14,359	4,105	0.006		0.007	27.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	89,413	2018/1/4	2018/1/5		204	204		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2018年1月5日の予定

*12月のマネタリーベース	*米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫	*国庫短期証券(730回)入札(3ヶ月、44,000億円、1/10発行)
*12月実績/1月見込み財政資金対民間収支	*米国11月の貿易収支	*流動性供給入札(3,000億円、1/10発行)
	*米国12月の雇用統計	*交付税特別会計借入(10,500億円、1/15借入)
	*米国12月のISM非製造業景況指数	
	*ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値	

◆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