

Central Daily Market Report

2018年1月9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	2018年1月9日		2018年1月10日		2018年1月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	4,200		4,200		4,000	
財政	▲ 22,600		▲ 700		2,000	
資金過不足	▲ 18,400		3,500		6,000	
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	2,200	▲ 5,200				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					10,000	
国債買入	9,700				3,000	
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
E T F買入	600		600			
国債補完供給	▲ 900	800		900		
当預増減	▲ 11,300		4,900		19,000	
当座預金残高	3,692,100		3,697,000		3,716,000	
準備預金残高	3,290,500					
積み終了先	3,290,300				1月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,290,300				積数	900
非準備預金先	401,600				1日平均	100
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	99.97%	日数	80.65%		

●2018年1月9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5,000億円増の328兆5,000億円(当座預金残高見込みは、369兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、信託、地銀、証券業態から▲0.055~▲0.045%のレンジでの調達希望で始まった。引き続き調達意欲は旺盛で、立ち上がりは▲0.04%が出合いの中心となった。一巡後は閑散とした展開であった。ターム物は1W物で▲0.04%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/10-1/11)は、▲0.085~▲0.08%程度での出合い。S/N(1/11-1/12)は、▲0.085~▲0.075%程度で出合い。短国買入オペが通知されたが、レート低下は限定的だった。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、短国買入オペが予想上限の10,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.006%、按分落札利回り較差+0.003%と業者の在庫の積みあがりを反映してか、小甘い結果となった。オペ後は堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は電機、商社業態からまとまった発行が見られ、総額1,700億円程度に達した。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/1/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.090	0.064	0.009	23,849.99	135.46	113.14-16	112.74-75
T/N			0.000				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.230	▲ 0.022				-	▲ 0.083						
2W			0.000				-	▲ 0.085						
3W			0.000				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.141	▲ 0.120						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.159						
									日付	12/27	12/28	12/29	1/4	1/5
									日銀当預残	3,696,000	3,689,300	3,686,100	3,701,200	3,703,400
									準備預金残	3,271,000	3,260,300	3,232,400	3,269,700	3,284,400
									マネタリーベース	4,807,200	4,803,700	4,801,100	4,810,400	4,808,600
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.036%	▲0.062%	▲0.047%	▲0.042%
									コール市場残高	112,455	102,155	80,591	93,029	100,302
									うち無担	89,702	79,222	58,175	70,300	77,086
									うちO/N	54,057	44,332	43,575	43,905	48,641
									うち有担	22,753	22,933	22,416	22,729	23,216

●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
国庫短期証券買入	10,000	2018/1/11			25,549	10,003	0.003		0.006	36.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/1/11			5,806	1,908	0.012		0.013	71.4
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/1/11			3,401	802	0.018		0.019	80.1
国債買入(物価連動債)	250	2018/1/11			1,485	251	▲0.120		▲0.159	86.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,922	2018/1/9	2018/1/10		594	594		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2018/1/9	2018/1/10		291	291		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/1/11	2018/1/19	1.92		1				

●2018年1月10日の予定

*米国11月の卸売売上高	*国庫短期証券(731回)入札 (6ヶ月、23,000億円、1/12発行)	*10年利付国債入札 (23,000億円、1/12発行)
--------------	--	---------------------------------

◆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