

Central Daily Market Report

2018年1月11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11日		2018年1月12日		2018年1月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,800		2,400		3,000	
財政	2,000		▲ 45,600		▲ 23,000	
資金過不足	4,800		▲ 43,200		▲ 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					1,600	▲ 3,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入	3,000				9,600	
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入	700					
国債補完供給	▲ 1,600	400		1,600		
当預増減	17,200		▲ 42,100		▲ 11,800	
当座預金残高	3,711,800		3,669,700		3,657,900	
準備預金残高	3,314,800					
積み終了先	3,314,600					
超過準備	3,314,600					
非準備預金先	397,000					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,061,100	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	87.10%		

●2018年1月11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1兆4,000億円増の331兆6,000億円(当座預金残高見込みは、371兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、引き続き前日対比で強めの展開で、信託、地銀、証券業態から▲0.03~▲0.025%テイクンの出会いが中心となった。一巡後も同水準の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(1/12-1/15)は、▲0.08~▲0.075%程度での出会い。S/N(1/15-1/16)は、▲0.09~▲0.075%程度で出会い。短国3M物、2年債の発行要因があるものの、積み最終日は資金運用サイド優勢でレートは低下した。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、20Y163、30Y57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(732回)の入札が実施された。WI取引において▲0.13~▲0.128%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1251%、按分落札利回▲0.1162%と按分レートが若干流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.127~▲0.12%出会いと堅調に推移した。その他には、6M物が▲0.132%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は15日発行となり、銘柄数には広がりは見られなかったものの、ゴム、電機、商社、不動産業態等からまとまった発行が見られ、総額2,800億円程度に膨らんだ。発行レートは横ばいで推移した。本日2,000億円で実施されたCP等買入オペは、前回オペ比で3,500億円の減額となったことや、特定銘柄が応札されたと思われることから、平均落札レート0.004%、按分落札レート0.000%といずれも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2018/1/11	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.089	0.065	▲ 0.015	23,710.43	▲ 77.77	111.44-46	111.78-79
T/N	▲ 0.035	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.084						
2W	0.000	0.020	0.013				-	▲ 0.086						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.125	▲ 0.117						
6M							▲ 0.131	▲ 0.141						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.155						
									日付	12/29	1/4	1/5	1/9	1/10
									日銀当預残	3,686,100	3,701,200	3,703,400	3,692,100	3,694,600
									準備預金残	3,232,400	3,269,700	3,284,400	3,290,800	3,299,400
									マネタリーベース	4,801,100	4,810,400	4,808,600	4,793,000	4,791,100
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.047%	▲0.042%	▲0.038%	▲0.036%
									コール市場残高	80,591	93,029	100,302	96,793	107,253
									うち無担	58,175	70,300	77,086	73,786	83,784
									うちO/N	43,575	43,905	48,641	44,671	54,079
									うち有担	22,416	22,729	23,216	23,007	23,469

●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)
国庫短期証券	732	-	43,600	2018/1/15	2018/4/16	149,839.0	35,831.60	100.0290	▲0.1162%	32.6570%	100.0312	▲0.1251%	7,768.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/1/15	2018/1/29		1,622	1,622				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/1/15			10,019	2,503	▲0.001		0.000	89.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/1/15			12,276	3,003	▲0.004		▲0.003	27.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/1/15			14,367	4,113	▲0.009		▲0.008	7.2
CP等買入	2,000	2018/1/16			7,708	1,990	0.000		0.004	82.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	158,847	2018/1/11	2018/1/12		1,534	1,534		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	35,369	2018/1/11	2018/1/12		61	61		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月12日の予定

*11月の国際収支	*米国11月の企業在庫	*40年利付国債入札(5,000億円、1/16発行)
*12月の景気ウォッチャー調査	*米国12月の消費者物価指数	*エネルギー対策借入(5,500億円、1/22借入)
	*米国12月の小売売上高	

◆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