

# Central Daily Market Report

2018年1月12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	2018年1月12日		2018年1月15日		2018年1月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,600		2,100		2,000	
財政	▲45,000		▲25,200		▲4,000	
資金過不足	▲42,400		▲23,100		▲2,000	
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					17,500	
国債買入			9,700			
CP等買入		▲500		▲400	2,000	
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	▲400	1,600		400		
当預増減	▲41,700		▲14,800		17,500	
当座預金残高	3,670,100		3,655,300		3,672,800	
準備預金残高	3,274,900					
積み終了先	3,274,800					1月15日以降の残り所要積立額
超過準備	3,274,700					積数
非準備預金先	395,200					1日平均
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	100.00%	日数	96.77%		

## ●2018年1月12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4兆円減の327兆6,000億円(当座預金残高見込みは、367兆円)。本日の無担O/Nは、信託、地銀、証券業態から▲0.03%の調達希望で始まった。前日同様高止まりの展開で、地銀、証券業態は▲0.025%近辺、信託業態では▲0.03%近辺の出会いが見られた。一巡後は取り下がり、▲0.05~▲0.03%の幅広いレンジで出会いが見られた。ターム物は新しい積み期間の16日スタートを中心に、1~2W物で▲0.04~▲0.035%の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(1/15-1/16)は、▲0.08~▲0.075%程度での出会い。S/N(1/16-1/17)は、▲0.09~▲0.08%程度で出会い。新積み期入りしたことに加え、短国買入オペが17,500億円通知されたことで資金調達ニーズが減少した。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、短国買入オペが事前予想を上回る17,500億円(前回比+7,500億円)でオファーされ、平均落札利回較差▲0.005%、按分落札利回較差▲0.011%としっかりした結果となった。オペ後は3M物が▲0.135%、1Y物が▲0.139%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社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800億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

2018/1/12	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	▲0.060	0.010	▲0.027				-	▲0.090	0.070	0.005	23,653.82	▲56.61	111.28-29	111.36-38
T/N			0.000				-	▲0.077						
S/N							-	-						
1W	▲0.035	0.000	▲0.015				-	▲0.084						
2W	▲0.043	0.001	▲0.019				-	▲0.086						
3W							-	▲0.093						
1M	▲0.009	0.060	0.027				-	▲0.095						
3M							▲0.137	▲0.116						
6M							▲0.135	▲0.142						
1Y							▲0.132	▲0.156						
									日付	1/4	1/5	1/9	1/10	1/11
									日銀当預残	3,701,200	3,703,400	3,692,100	3,694,600	3,711,800
									準備預金残	3,269,700	3,284,400	3,290,800	3,299,400	3,314,800
									マネタリーベース	4,810,400	4,808,600	4,793,000	4,791,100	4,805,600
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.042%	▲0.038%	▲0.036%	▲0.030%
									コール市場残高	93,029	100,302	96,793	107,253	102,523
									うち無担	70,300	77,086	73,786	83,784	78,694
									うちO/N	43,905	48,641	44,671	54,079	49,739
									うち有担	22,729	23,216	23,007	23,469	23,829

## ●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)
40年利付国債	10	0.90%	5,000	2018/1/16	2057/3/20	18,354.0	4,996.00		0.9850%	10.8072%			
エネルギー対策	-	-	5,500	2018/1/22	2019/1/22	82,279.0	5,499.97		0.0000%	6.6847%		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	17,500	2018/1/16			35,068	17,501	▲0.011		▲0.005	17.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	111,834	2018/1/12	2018/1/15		211	211		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,944	2018/1/12	2018/1/15		134	134		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第81回	2018/1/19	2019/1/18	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第20回	2018/1/19	2019/1/18	2

## ●2018年1月15日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*11月の特定サービス産業動態統計速報 *12月のマネーストック	*New York祝日(Martin L.King Jr.'s Day)
--------------------------	-------------------------------------	--------------------------------------

◆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