

Central Daily Market Report

2018年1月15日(月)
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15日		2018年1月16日		2018年1月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,300		2,000		1,000	
財政	▲ 28,700		▲ 2,400		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 26,400		▲ 400		0	
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				6,800	
CP等買入		▲ 400	2,000	▲ 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						
国債補完供給	▲ 1,000	400		1,000		
当預増減	▲ 19,100		20,000		6,800	
当座預金残高	3,651,000		3,671,000		3,677,800	
準備預金残高	3,249,600					
積み終了先	3,249,600				1月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,249,500				積数 3,066,300	
非準備預金先	401,400				1日平均 98,900	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,066,300	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2018年1月15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2兆8,000億円減の324兆8,000億円(当座預金残高見込みは、365兆5,000億円)。積み最終日である本日の無担O/Nは、先週末同様に高止まりの地合いで、地銀・信託・証券を中心に▲0.03~▲0.025%の出合いが始まった。一巡後は閑散で、▲0.05~▲0.025%の幅広いレンジでの出合いが散見された。ターム物は様子見姿勢で閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(1/16-1/17)は▲0.125~▲0.095%程度、S/N(1/17-1/18)は▲0.11~▲0.10%程度で出合いが見られた。新しい積み期間にかかる16日以降の取引は、前週の短国買入オペ増額もあってオファーが出難く、レートは低下基調となった。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5Y127、130、131、134、10Y336、341、348、20Y163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動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額200億円程度に対して、発行総額は100億円程度と若干の償還超であった。案件数が少なく盛り上がり欠けるマーケットであった。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

2018/1/15	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	▲ 0.050	0.005	▲ 0.029				-	▲ 0.073	0.070	0.000	23,714.88	61.06	111.14-15	110.81-82
T/N			0.000				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.015				-	▲ 0.101						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.138	▲ 0.119						
6M							▲ 0.135	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.156						
									日付	1/5	1/9	1/10	1/11	1/12
									日銀当預残	3,703,400	3,692,100	3,694,600	3,711,800	3,670,100
									準備預金残	3,284,400	3,290,800	3,299,400	3,314,800	3,275,600
									マネタリーベース	4,808,600	4,793,000	4,791,100	4,805,600	4,761,200
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.038%	▲0.036%	▲0.030%	▲0.027%
									コール市場残高	100,302	96,793	107,253	102,523	100,907
									うち無担	77,086	73,786	83,784	78,694	78,302
									うちO/N	48,641	44,671	54,079	49,739	48,537
									うち有担	23,216	23,007	23,469	23,829	22,605

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/1/17			15,883	4,109	0.002		0.003	41.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/1/17			6,139	1,903	0.005		0.006	46.8
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/1/17			2,949	806	▲0.002		▲0.002	74.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	51,261	2018/1/15	2018/1/16		209	209		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	63,427	2018/1/15	2018/1/16		718	718		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月16日の予定

*11月の第3次産業活動指数	*英国12月の消費者物価指数	*5年利付国債入札(22,000億円、1/18発行)
*12月の企業物価指数		*交付税特別会計借入(10,500億円、1/24借入)

◆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