

Central Daily Market Report

2018年1月18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18日		2018年1月19日		2018年1月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		700		1,000	
財政	▲ 23,600		1,300		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 23,000		2,000		▲ 22,000	
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					1,400	▲ 2,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,000			
CP等買入		▲ 300		▲ 100	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援				▲ 200		
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 300	200		300		
当預増減	▲ 23,400		8,000		▲ 20,300	
当座預金残高	3,663,100		3,671,100		3,650,800	
準備預金残高	3,229,900					
積み終了先	3,187,500					
超過準備	3,144,100					
非準備預金先	433,200					
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	97.58%	日数	9.68%		

●2018年1月18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2兆4,000億円減の322兆5,000億円(当座預金残高見込みは366兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・証券業態を中心に▲0.04~▲0.035%での調達で始まった。昨日と同様に、一巡後は散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/19-1/22)は▲0.09~▲0.075%程度、S/N(1/22-1/23)は▲0.085~▲0.075%程度で出合いが見られた。1/22は短国の発行日にあたり、小幅にレートが上昇した。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5Y124、126、130、10Y341、348、20Y163などにピッドの出入りが目立った一方、リオープンとなった30Y571は緩んだ。

<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(734回)の入札が実施された。WI取引において▲0.163~▲0.158%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1559%、按分落札利回▲0.1443%と強い結果となった。セカンダリーでは▲0.15%で出合い、底堅く推移した。その他には、1Y物が▲0.145%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額500億円強に対して、発行総額は1,000億円強と発行超。一部の卸売業態において大型案件が見られたことで案件数は膨らんだものの、全般的に小型案件が中心であった。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

2018/1/18	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.088	0.075	▲ 0.005	23,763.37	▲ 104.97	111.34-36	111.23-25
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.036				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.038	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.098						
3M			0.460				▲ 0.149	▲ 0.121						
6M							▲ 0.135	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.146	▲ 0.157						
									日付	1/11	1/12	1/15	1/16	1/17
									日銀当預残	3,711,800	3,670,100	3,651,000	3,674,300	3,686,500
									準備預金残	3,314,800	3,275,600	3,249,600	3,237,700	3,250,200
									マネタリーベース	4,805,600	4,761,200	4,739,900	4,761,000	4,771,800
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.027%	▲0.029%	▲0.042%	▲0.042%
									コール市場残高	102,523	100,907	105,747	99,697	96,217
									うち無担	78,694	78,302	81,457	73,937	73,056
									うちO/N	49,739	48,537	52,152	44,822	43,506
									うち有担	23,829	22,605	24,290	25,760	23,161

●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	734	-	44,200	2018/1/22	2018/4/23	166,497.0	35,888.6	100.0360	▲0.1443%	57.1651%	100.0389	▲0.1559%	8,311.0
30年利付国債	57	0.80%	8,000	2018/1/22	2047/12/20	24,750.0	6,570.0	99.1000	0.8370%	25.8603%	99.2300	0.8320%	1,421.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/1/26	2018/7/26	167,015.0	10,500.11		0.0000%	6.2870%		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	入札総額(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	2018/1/22	2018/2/5		1,421	1,421				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	95,231	2018/1/18	2018/1/19		228	228		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	29,772	2018/1/18	2018/1/19		50	50		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月19日の予定

*月例経済報告

*11月の石油等消費動態統計

*米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報

◆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