

Central Daily Market Report

2018年1月19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19日 需給速報	2018年1月22日 需給予想	2018年1月23日 当社予想			
銀行券	800	1,200	0			
財政	500	▲ 12,800	2,000			
資金過不足	1,300	▲ 11,600	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			1,400	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					12,500	
国債買入	6,000				6,800	
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 100		
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						
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	7,000	▲ 9,000				21,300
当座預金残高	3,670,100	3,661,100	3,682,400			
準備預金残高	3,232,600					
積み終了先	3,225,100			1月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,215,700			積数	23,500	
非準備預金先	437,500			1日平均	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	99.23%	日数	19.35%		

●2018年1月19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1兆2,000億円増の323兆7,000億円(当座預金残高見込みは367兆1,000億円)。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。週末要因により、▲0.035%まで取り上がる先が増えたものの、一巡後は散発的に出合う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(1/22-1/23)は▲0.08~▲0.07%程度、S/N(1/23-1/24)は▲0.09~▲0.08%程度で出合いが見られた。短国買入オペの影響もあり、S/Nの取引ではやや調達意欲が減退した。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、131、10Y341、342、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、短国買入オペが事前予想通りの12,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。堅調なマーケットを反映してか、平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差▲0.003%と小じかりの結果となった。オペ後は3M物が▲0.158~▲0.155%、1Y物が▲0.155~▲0.147%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500億円弱に対して、発行総額は1,000億円弱と発行超となった。一部の卸売・小売業態において大型案件が見られたものの、全般的に小型案件が中心となった。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

2018/1/19	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	▲ 0.041				-	▲ 0.087	0.075	0.000	23,808.06	44.69	111.03-05	110.69-70
T/N			0.000				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.153	▲ 0.119						
6M							▲ 0.135	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.156						
									日付	1/12	1/15	1/16	1/17	1/18
									日銀当預残	3,670,100	3,651,000	3,674,300	3,686,500	3,663,100
									準備預金残	3,275,600	3,249,600	3,237,700	3,250,200	3,230,000
									マネタリーベース	4,761,200	4,739,900	4,761,000	4,771,800	4,747,800
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.029%	▲0.042%	▲0.042%	▲0.042%
									コール市場残高	100,907	105,747	99,697	96,217	95,838
									うち無担	78,302	81,457	73,937	73,056	71,737
									うちO/N	48,537	52,152	44,822	43,506	43,227
									うち有担	22,605	24,290	25,760	23,161	24,101

●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)	応募率(%)	落札最低額	落札最高利回	案分率	落札平均価格	落札平均利回	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	12,500	2018/1/23			21,967	12,501	▲0.003		0.001	61.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/1/23			14,148	4,109	0.006		0.007	52.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/1/23			4,681	1,906	0.002		0.003	55.7
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/1/23			2,335	806	0.005		0.006	36.7
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	13,946	2018/1/19	2018/1/22		273	273		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月22日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、23日まで)	*流動性供給入札(5,500億円、1/24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