

Central Daily Market Report

2018年1月29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29日		2018年1月30日		2018年1月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		600		▲ 300	
財政	▲ 13,300		1,500		▲ 1,400	
資金過不足	▲ 12,800		2,100		▲ 1,700	
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	1,300	▲ 1,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			8,400		4,900	
CP等買入		▲ 100		▲ 100	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F買入			800			
国債補完供給	▲ 500	800		500		
当預増減	▲ 12,900		19,000		5,700	
当座預金残高	3,666,900		3,685,900		3,691,600	
準備預金残高	3,245,100					
積み終了先	3,244,100		1月30日以降の残り所要積立額		積数 4,400	
超過準備	3,243,600				1日平均 300	
非準備預金先	421,800					
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		99.86%		日数 45.16%	

●2018年1月29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4,000億円増の324兆4,000億円(当座預金残高見込みは366兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・証券業態を中心に▲0.05~▲0.035%での調達で始まった。週末に比べ、ビッド数がやや減少した事で低調な地合いとなり、一巡後は▲0.065~▲0.06%で散発的な出会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会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/30-1/31)は▲0.080~▲0.075%程度、S/N(1/31-2/1)は▲0.090~▲0.085%程度で出会い。S/Nは月末初取引となることから、寄付きはオファーが出難く、小幅にレートを引き下げた。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5Y134、10Y330~349、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なか、3M物のWI取引で▲0.16%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、月末発行に当たり幅広い業態で発行がみられ、活況なマーケットとなった。鉄鋼、機械、ゴム製品等複数業態で500億円超の大ロットの発行が行われたこともあり、発行総額は8,600億円超まで膨らんだものの、償還総額1兆1,500億円程度は下回った。発行案件が膨らむ一方、期越え物は限定的で多くが期内物の発行であった。発行レートに特段の変化はなく、0%近辺の狭いレンジで推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/1/29	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.080	0.080	0.010	23,629.34	▲ 2.54	108.60-62	108.93-94
T/N			0.000				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.035	0.080	▲ 0.016				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M			0.000				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.156	▲ 0.117						
6M							▲ 0.138	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.159						
									日付	1/22	1/23	1/24	1/25	1/26
									日銀当預残	3,655,800	3,676,500	3,666,800	3,669,900	3,679,800
									準備預金残	3,246,400	3,251,600	3,228,200	3,229,400	3,240,100
									マネタリーベース	4,738,600	4,759,200	4,749,200	4,752,800	4,762,900
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.041%	▲0.036%	▲0.041%	▲0.040%
									コール市場残高	100,736	102,147	108,655	103,297	102,501
									うち無担	77,258	79,123	85,429	79,781	79,163
									うちO/N	46,898	48,363	54,559	48,581	48,433
									うち有担	23,478	23,024	23,226	23,516	23,338

●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	落札最高利率	案分率	落札平均価格	落札平均利率	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1年以下)	500	2018/1/31			2,194	500	0.008		0.013	15.0
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,100	2018/1/31			13,962	4,112	0.010		0.011	75.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/1/31			1,713	252	▲0.170		▲0.198	80.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2018/1/29	2018/1/30		490	490		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月30日の予定

*12月の完全失業率(市場予想：2.7%)	*米国FOMC(1日目)
*12月の有効求人倍率(市場予想：1.57倍)	*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*12月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+1.7%)	*米国1月のCB消費者信頼感指数
*12月の商業動態統計速報	*ユーロ圏10-12月期のGDP1次速報
	*2年利付国債入札(22,000億円、2/15発行)
	*交付税特別会計借入(10,500億円、2/7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