

Central Daily Market Report

2018年1月30日(火)

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30日		2018年1月31日		2018年2月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		200			0
財政	1,600		▲ 4,100		▲ 7,000	
資金過不足	2,200		▲ 3,900		▲ 7,000	
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						
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	2,500	▲ 3,300		
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		▲ 100		
E T F買入	800		400			
国債補完供給	▲ 200	500		200		
当預増減	18,900		700		▲ 7,000	
当座預金残高	3,685,800		3,686,500		3,679,500	
準備預金残高	3,264,700					
積み終了先	3,263,800				1月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,263,800				積数	3,500
非準備預金先	421,100				1日平均	200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						3,066,600
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	48.39%		

●2018年1月30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2兆1,000億円増の326兆5,000億円(当座預金残高見込みは368兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀業態で▲0.055~▲0.035%、証券業態で▲0.06~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は▲0.065~▲0.06%で散發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、目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/31-2/1)は▲0.080~▲0.070%程度、S/N(2/1-2/2)は▲0.080~▲0.075%程度で出合い。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物が▲0.16%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼やガラス・土石製品でまとまった額の調達が行われ、発行総額は1,400億円弱と償還総額500億円程度を上回った。発行レートは、一部銘柄を除き、引続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/1/30	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.081	0.090	0.010	23,291.97	▲ 337.37	108.94-96	108.75-76
T/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.164	▲ 0.022				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.030	0.080	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
3W			0.000				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.035	0.060	▲ 0.031				-	▲ 0.094						
3M			0.070				▲ 0.157	▲ 0.117						
6M							▲ 0.138	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.153	▲ 0.159						
									日付	1/23	1/24	1/25	1/26	1/29
									日銀当預残	3,676,500	3,666,800	3,669,900	3,679,800	3,666,900
									準備預金残	3,251,600	3,228,200	3,229,400	3,240,100	3,245,900
									マネタリーベース	4,759,200	4,749,200	4,752,800	4,762,900	4,749,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.036%	▲ 0.041%	▲ 0.040%	▲ 0.043%
									コール市場残高	102,147	108,655	103,297	102,501	99,548
									うち無担	79,123	85,429	79,781	79,163	76,103
									うちO/N	48,363	54,559	48,581	48,433	46,263
									うち有担	23,024	23,226	23,516	23,338	23,445

●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)
2年利付国債	385	0.10%	22,000	2018/2/15	2020/2/15	88,907.0	17,703.0	100.4600	▲0.1290%	46.1768%	100.4630	▲0.1300%	4,288.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/2/7	2018/8/7	181,023.0	10,500.13		0.0000%	5.8005%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,000	2018/1/30	2018/1/31		143	143		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,607	2018/1/30	2018/1/31		20	20		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/2/1	2018/2/8	1.91	0	0				

●2018年1月31日の予定

- *岩田日銀副総裁、大分県金融経済懇談会にて講演
- *米国FOMC(2日目)
- *決定会合における主な意見(1月22、23日分)
- *米国1月のシカゴPM景況感指数
- *12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+1.6%)
- *ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値
- *12月の住宅着工統計
- *1月の消費動向調査

◆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