

Central Daily Market Report

2018年1月31日(水)
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31日		2018年2月1日		2018年2月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		0		0	
財政	▲ 4,400		▲ 6,700		▲ 58,000	
資金過不足	▲ 4,100		▲ 6,700		▲ 58,000	
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						
国債買入	4,900				8,500	
CP等買入	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		▲ 100				
E T F買入	400					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	400		▲ 6,600		▲ 49,500	
当座預金残高	3,686,200		3,679,600		3,630,100	
準備預金残高	3,247,100					
積み終了先	3,246,100				2月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,246,100				積数 2,500	
非準備預金先	439,100				1日平均 200	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,062,000	
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数	51.61%		

●2018年1月31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5,000億円減の326兆円(当座預金残高見込みは368兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀業態で▲0.05~▲0.035%、証券業態で▲0.065~▲0.05%での調達で始まった。月末要因によりビッド件数が少なく軟調な展開のなか、一巡後は▲0.07%台で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、1~2W物で▲0.03%台の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(2/1-2/2)は▲0.080~▲0.075%程度、S/N(2/2-2/5)は▲0.075~▲0.070%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3M物の入札を控えて閑散な中、3M物が▲0.161%、6M物が▲0.155%、WI取引で3M物が▲0.17%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、案件数は膨らまないものの、機械や卸売等業態で大ロットの調達が行われ、償還総額800億円程に対し発行総額は1,500億円弱と発行超のマーケットとなった。発行レートについては、大ロットの物も安定的に消化されており、引き続き0%近辺の低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/1/31	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.083	0.080	▲ 0.010	23,098.29	▲ 193.68	108.75-77	108.69-70
T/N			0.000				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.180	▲ 0.019				-	▲ 0.081						
2W	0.000	0.110	0.044				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.160	▲ 0.116						
6M							▲ 0.140	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.159						
									日付	1/24	1/25	1/26	1/29	1/30
									日銀当預残	3,666,800	3,669,900	3,679,800	3,666,900	3,685,800
									準備預金残	3,228,200	3,229,400	3,240,100	3,245,900	3,264,700
									マネタリーベース	4,749,200	4,752,800	4,762,900	4,749,500	4,767,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.036%	▲ 0.041%	▲ 0.040%	▲ 0.043%	▲ 0.044%
									コール市場残高	108,655	103,297	102,501	99,548	98,564
									うち無担	85,429	79,781	79,163	76,103	75,994
									うちO/N	54,559	48,581	48,433	46,263	46,654
									うち有担	23,226	23,516	23,338	23,445	22,570

●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1年超3年以下)	2,500	2018/2/2			12,166	2,501	▲0.007		▲0.006	29.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/2/2			11,193	3,305	▲0.008		▲0.008	98.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/2/2			4,458	1,907	▲0.007		▲0.004	66.9
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/2/2			2,812	804	0.002		0.003	34.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	41,793	2018/1/31	2018/2/1		124	124		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/1/31	2018/2/1		21	21		▲0.500	▲0.500	

●2018年2月1日の予定

*米国12月の建設支出	*国庫短期証券(736回)入札(3ヶ月、44,000億円、2/5発行)	*10年利付国債入札(23,000億円、2/5発行)
*米国1月のISM製造業景況指数		

◆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