

Central Daily Market Report

2018年2月2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2月2日		2018年2月5日		2018年2月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		1,100		1,000	
財政	▲ 74,500		▲ 21,000		0	
資金過不足	▲ 74,400		▲ 19,900		1,000	
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	▲ 1,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					7,500	
国債買入	8,700				7,200	
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
国債補完供給	▲ 800	600		800		
当預増減	▲ 66,100		▲ 19,400		15,700	
当座預金残高	3,612,200		3,592,800		3,608,500	
準備預金残高	3,195,600					
積み終了先	3,195,500		2月5日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	3,195,500				1,600	
非準備預金先	416,600				1日平均	
					100	
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		99.95%		日数	
					64.52%	

●2018年2月2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53,000億円減少の320兆1,000億円(当座預金残高見込みは361兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、税揚げ要因等からレートは前日比で上昇した。朝方は地銀業態で▲0.045~▲0.035%、証券業態で▲0.055~▲0.045%、信託業態で▲0.06%近辺の調達が見られた。一巡後は、散発的な出会いが見られた程度となった。ターム物はオファーが出難い状態が続いており、特段目立った動きは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/5-2/6)は▲0.070~▲0.065%程度、S/N(2/6-2/7)は▲0.075~▲0.070%程度で出会い。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、短国買入オペが前回と同額の7,500億円でオファーされた。応札額は2兆円台と多かったものの、平均落札利回較差▲0.004%、按分落札利回較差▲0.007%と堅調なマーケットを反映して、しっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.165~▲0.16%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は非鉄金属業態の発行1件のみであり、償還総額900億円程度に対し、発行総額は50億円弱と閑散なマーケットだった。発行レートはやや低下する動きも見られたが、概ね横ばい圏となった。

●短期金融市場関連指標

2018/2/2	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.077	0.080	▲ 0.010	23,274.53	▲ 211.58	109.40-41	109.77-78
T/N			0.000				-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.078						
2W							-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.089						
1M			0.010				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.162	▲ 0.116						
6M							▲ 0.140	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.160						
									日付	1/26	1/29	1/30	1/31	2/1
									日銀当預残	3,679,800	3,666,900	3,685,800	3,686,200	3,678,300
									準備預金残	3,240,100	3,245,900	3,264,700	3,247,100	3,255,700
									マネタリーベース	4,762,900	4,749,500	4,767,700	4,767,900	4,760,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.040%	▲ 0.043%	▲ 0.044%	▲ 0.050%	▲ 0.045%
									コール市場残高	102,501	99,548	98,564	96,482	106,026
									うち無担	79,163	76,103	75,994	73,433	82,511
									うちO/N	48,433	46,263	46,654	46,068	55,156
									うち有担	23,338	23,445	22,570	23,049	23,515

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2018/2/14	2018/8/14	168,813.0	10,500.01		0.0000%	6.6325%		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
国庫短期証券買入	7,500	2018/2/6			22,138	7,501	▲0.007		▲0.004	66.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/2/6			12,665	4,506	▲0.007		▲0.005	42.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/2/6			4,081	1,902	▲0.007		▲0.002	90.0
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/2/6			2,323	805	0.005		0.006	62.2
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	74,308	2018/2/2	2018/2/5		797	797		▲0.500	▲0.500	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)		2018/2/6			0	0				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.020%。この結果、10年利付国債349回の買入利回りは、0.110%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2018年2月5日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国1月のISM非製造業景況指数

◆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