

Central Daily Market Report

2018年2月5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2月5日 | | 2018年2月6日 | | 2018年2月7日 | |
|-----------------------|-----------|---------|-----------|--------|-----------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 1,100 | | 700 | | 1,000 | |
| 財政 | ▲ 21,100 | | 2,400 | | 1,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 20,000 | | 3,100 | | 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 | ▲ 1,400 | | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | 7,500 | | | |
| 国債買入 | | | 7,300 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | | ▲ 200 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| E T F買入 | | | 500 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 600 | 800 | | 600 | | |
| 当預増減 | ▲ 20,100 | | 18,800 | | 2,000 | |
| 当座預金残高 | 3,592,100 | | 3,610,900 | | 3,612,900 | |
| 準備預金残高 | 3,192,100 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,191,900 | | | | | |
| 超過準備 | 3,191,900 | | | | | |
| 非準備預金先 | 400,000 | | | | | |
| 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 | 67.74% | | |

●2018年2月5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1兆4,000億円減少の318兆7,000億円(当座預金残高見込みは359兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態から▲0.075~▲0.055%、地銀業態から▲0.055~▲0.035%、証券業態から▲0.060~▲0.045%での調達で始まり、取り一巡後は落ち着いた取引となった。ターム物は、ショートタームでの取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/6-2/7)は▲0.075~▲0.07%程度、S/N(2/7-2/8)は▲0.075~▲0.065%程度での出会い。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5Y133~134、10Y330~349、20Y163、30Y57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で、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、案件少なく閑散なマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

| 2018/2/5 | 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 | 売買参考値 | 平均値 | 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 |
| O/N | ▲ 0.078 | 0.001 | ▲ 0.044 | | | | - | ▲ 0.077 | 0.080 | 0.000 | | 22,682.08 | ▲ 592.45 | 110.02-04 | 109.90-91 |
| T/N | | | 0.000 | | | | - | ▲ 0.072 | | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | | |
| 1W | | | ▲ 0.030 | | | | - | ▲ 0.078 | | | | | | | |
| 2W | | | ▲ 0.015 | | | | - | ▲ 0.083 | | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.089 | | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.038 | | | | - | ▲ 0.094 | | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.163 | ▲ 0.117 | | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.140 | ▲ 0.145 | | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.160 | ▲ 0.160 | | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 1/29 | 1/30 | 1/31 | 2/1 | 2/2 | |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,666,900 | 3,685,800 | 3,686,200 | 3,678,300 | 3,612,200 | |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,245,900 | 3,264,700 | 3,247,100 | 3,255,700 | 3,195,900 | |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,749,500 | 4,767,700 | 4,767,900 | 4,760,100 | 4,693,900 | |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.043% | ▲ 0.044% | ▲ 0.050% | ▲ 0.045% | ▲ 0.042% | |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 99,548 | 98,564 | 96,482 | 106,026 | 111,375 | |
| | | | | | | | | | うち無担 | 76,103 | 75,994 | 73,433 | 82,511 | 88,915 | |
| | | | | | | | | | うちO/N | 46,263 | 46,654 | 46,068 | 55,156 | 60,130 | |
| | | | | | | | | | うち有担 | 23,445 | 22,570 | 23,049 | 23,515 | 22,460 | |

●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 | 申込総額(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) | 55,698 | 2018/2/5 | 2018/2/6 | | 536 | 536 | | ▲ 0.500 | ▲ 0.500 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 6,617 | 2018/2/5 | 2018/2/6 | | 6 | 6 | | ▲ 0.500 | ▲ 0.500 | |

●2018年2月6日の予定

| | | |
|-----------------------------|-------------|---------------------------------|
| *桑原日銀理事、 決済システムフォーラムにて講演 | *米国12月の貿易収支 | *10年物価連動国債入札 (4,000億円、2/8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