

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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
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