

Central Daily Market Report

2018年2月6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2月6日		2018年2月7日		2018年2月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		600		0	
財政	1,800		▲ 1,000		▲ 3,000	
資金過不足	2,500		▲ 400		▲ 3,000	
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	7,300					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	▲ 900	600		900		
当預増減	17,300		300		▲ 3,000	
当座預金残高	3,609,400		3,609,700		3,606,700	
準備預金残高	3,193,500					
積み終了先	3,193,400		2月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,193,400		積数		1,200	
非準備預金先	415,900		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	99.96%	日数		70.97%	

●2018年2月6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4,000億円増加の319兆1,000億円(当座預金残高見込みは361兆1,000億円)。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▲0.050~▲0.030%、証券業態から▲0.060~▲0.050%での調達で始まり、一部の地銀業態から取り上がる動きが見られた。ターム物では、1W~3W物の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/7-2/8)は▲0.075~▲0.065%程度、S/N(2/8-2/9)は▲0.08~▲0.07%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6M物の入札を控え、様子見姿勢が強く閑散な中、3M物が▲0.165~▲0.16%、WI取引で3M物が▲0.165%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

2018/2/6	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	売買差	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.030	▲ 0.041				-	▲ 0.075	0.070	▲ 0.010	21,610.24	▲ 1071.84	109.06-07	109.02-03
T/N	0.000	0.030	0.018				-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.180	▲ 0.010				-	▲ 0.080						
2W	0.030	0.150	0.084				-	▲ 0.083						
3W	0.120	0.130	0.128				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.025	0.100	▲ 0.003				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.162	▲ 0.117						
6M							▲ 0.141	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.160						
									日付	1/30	1/31	2/1	2/2	2/5
									日銀当預残	3,685,800	3,686,200	3,678,300	3,612,200	3,592,100
									準備預金残	3,264,700	3,247,100	3,255,700	3,195,900	3,192,100
									マネタリーベース	4,767,700	4,767,900	4,760,100	4,693,900	4,672,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.050%	▲ 0.045%	▲ 0.042%	▲ 0.044%
									コール市場残高	98,564	96,482	106,026	111,375	103,416
									うち無担	75,994	73,433	82,511	88,915	80,622
									うちO/N	46,654	46,068	55,156	60,130	51,987
									うち有担	22,570	23,049	23,515	22,460	22,794

●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)
物価連動10年	22	0.10%	4,000	2018/2/8	2027/3/10	13,527.0	4,000.00	105.3500	▲0.4640%	5.0000%			

●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	入札総額(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)	49,604	2018/2/6	2018/2/7		812	812		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/2/8	2018/2/15	1.92	0	0				

●2018年2月7日の予定

- *12月の毎月勤労統計調査速報
- *12月の景気動向指数速報
- *1月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国12月の消費者信用残高
- *国庫短期証券(737回)入札(6ヶ月、23,000億円、2/13発行)
- *エネルギー対策借入(5,000億円、2/20借入)

◆本資料は信頼できるとさ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