

# Central Daily Market Report

2018年2月7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2月7日		2018年2月8日		2018年2月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲ 300				0
財政	▲ 1,100	▲ 10,400				1,000
資金過不足	▲ 500	▲ 10,700				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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						10,600
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
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						
国債補完供給	▲ 700	900		700		
当預増減	▲ 500		▲ 10,100			11,600
当座預金残高	3,608,900		3,598,800			3,610,400
準備預金残高	3,197,200					
積み終了先	3,197,000				2月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,197,000				積数	1,100
非準備預金先	411,700				1日平均	100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						3,069,100
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

## ●2018年2月7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319兆5,000億円(当座預金残高見込みは361兆円)。本日の無担O/Nは、都銀・信託業態から▲0.075~▲0.050%、地銀業態から▲0.050~▲0.030%、証券業態から▲0.055~▲0.045%での調達で始まった。朝方は地銀業態から強めの出合いが見られたが、一巡後は全般的に落ち着いた取引となった。ターム物は、月内中心のショートタームでの出合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(2/8-2/9)は▲0.08~▲0.07%程度、S/N(2/9-2/13)は▲0.10~▲0.085%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2Y381~2y384、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(737回)の入札が実施された。WI取引では特段の出合いは見られなかったものの、結果は平均落札利回▲0.1495%、按分落札利回▲0.1454%としっかりした結果となった。セカンダリーでは▲0.155~▲0.15%で出合い、強含みで推移した。この他には、3M物が▲0.157%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10日の前倒し日であったが案件少なく、2,500億円程度の償還に対して、発行は800億円程度であった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/7	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.078	0.070	0.000	21,645.37	35.13	109.62-64	109.03-05
T/N	0.000	0.050	0.012				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.040	▲ 0.025				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.030	0.030	▲ 0.001				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.091						
1M			0.030				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.161	▲ 0.118						
6M							▲ 0.156	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.160						
									日付	1/31	2/1	2/2	2/5	2/6
									日銀当預残	3,686,200	3,678,300	3,612,200	3,592,100	3,609,400
									準備預金残	3,247,100	3,255,700	3,195,900	3,192,100	3,193,900
									マネタリーベース	4,767,900	4,760,100	4,693,900	4,672,800	4,689,300
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.045%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.041%
									コール市場残高	96,482	106,026	111,375	103,416	101,924
									うち無担	73,433	82,511	88,915	80,622	79,901
									うちO/N	46,068	55,156	60,130	51,987	50,836
									うち有担	23,049	23,515	22,460	22,794	22,023

## ●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)
国庫短期証券	737	-	23,000	2018/2/13	2018/8/10	97,285.0	18,887.60	100.0710	▲0.1454%	95.3604%	100.0730	▲0.1495%	4,112.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2018/2/20	2019/2/20	74,812.0	4,999.97		0.0000%	6.6835%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/2/9			8,502	2,501	0.001		0.001	80.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/2/9			12,839	3,301	0.009		0.009	94.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/2/9			14,775	4,512	0.006		0.007	12.8
国債買入(物価連動債)	250	2018/2/9			1,316	252	0.090		0.028	4.3
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	46,957	2018/2/7	2018/2/8		650	650		▲0.500	▲0.500	

## ●2018年2月8日の予定

*鈴木日銀審議委員、和歌山県金融経済懇談会にて講演	*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(738回)入札(3ヶ月、44,000億円、2/13発行)
*12月の国際収支		*30年利付国債入札(8,000億円、2/13発行)
*12月の特定サービス産業動態統計速報		
*1月の景気ウォッチャー調査		

◆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