

# Central Daily Market Report

2018年2月8日(木)

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8日		2018年2月9日		2018年2月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 400		1,000	
財政	▲ 10,800		900		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 11,100		500		▲ 7,000	
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					900	▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,800			
CP等買入		▲ 100		▲ 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			400			
国債補充供給	▲ 500	700		500		
当預増減	▲ 11,000		12,000		▲ 7,600	
当座預金残高	3,597,900		3,609,900		3,602,300	
準備預金残高	3,173,300					
積み終了先	3,173,200					
超過準備	3,173,200					
非準備預金先	424,600					
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	99.97%	日数	77.42%		

## ●2018年2月8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14,000億円減少の318兆1,000億円(当座預金残高見込みは359兆9,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き強めの地合いとなり、朝方は地銀・証券業態で▲0.045~▲0.025%、信託業態で▲0.05%近辺の調達が見られた。一巡後は、散發的な出会いが見られた程度となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。共通担保資金供給オペは、1W物(2/13~2/26)8,000億円のオファーに対し、応札額803億円(期落ち分1,312億円)、3M物(2/13~5/21)5,000億円のオファーに対し、応札額80億円(期落ち分170億円)といずれも札割れとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/9-2/13)は▲0.095~▲0.085%程度、S/N(2/13-2/14)は▲0.095~▲0.085%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2Y381~384、5Y133~134、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、3M(738回)の入札が実施された。WI取引において▲0.153~▲0.152%での出会いが見られる中、結果は平均落札利回▲0.1524%、按分落札利回▲0.1479%と前回債からレートは小幅上昇となったものの、引き続き堅調な入札となった。セカンダリーでは▲0.158~▲0.1525%の出会いと強含みで推移した。その他には、6M物が▲0.158%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、案件こそ少なかったものの、電機業態等からの大型案件が見られ、800億円程度の償還に対して、発行は1,200億円程度となった。レートは概ね0%近辺での決着であった。本日はCP等買入オペがオファー額2,500億円で実施された。入札結果は按分落札レートが▲0.001%と前回(▲0.001%)から横ばい、平均落札レートが0%と前回(0.001%)比で低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/8	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.085	0.075	0.005	21,890.86	245.49	109.14-16	109.53-54
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.025				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.094						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.156	▲ 0.123						
6M							▲ 0.158	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.162						
									日付	2/1	2/2	2/5	2/6	2/7
									日銀当預残	3,678,300	3,612,200	3,592,100	3,609,400	3,608,900
									準備預金残	3,255,700	3,195,900	3,192,100	3,193,900	3,197,200
									マネタリーベース	4,760,100	4,693,900	4,672,800	4,689,300	4,688,200
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.042%	▲0.044%	▲0.041%	▲0.038%
									コール市場残高	106,026	111,375	103,416	101,924	102,842
									うち無担	82,511	88,915	80,622	79,901	80,650
									うちO/N	55,156	60,130	51,987	50,836	50,615
									うち有担	23,515	22,460	22,794	22,023	22,192

## ●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	738	-	44,200	2018/2/13	2018/5/14	159,708.0	36,290.40	100.0365	▲0.1479%	62.5158%	100.0376	▲0.1524%	7,909.0
30年利付国債	57	0.80%	8,000	2018/2/13	2047/12/20	27,631.0	6,467.00	99.4500	0.8220%	92.6464%	99.5000	0.8200%	1,521.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/2/13	2018/2/26		803	803				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	5,000	2018/2/13	2018/5/21		80	80				
CP等買入	2,500	2018/2/14			7,635	2,483	▲0.001		0.000	95.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,000	2018/2/8	2018/2/9		417	417		▲0.500	▲0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/2/8	2018/2/9		100	100		▲0.500	▲0.500	

## ●2018年2月9日の予定

- \*12月の第3次産業活動指数
- \*1月のマネーストック
- \*米国12月の卸売売上高

◆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