

Central Daily Market Report

2018年2月9日(金)

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9日		2018年2月13日		2018年2月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		900			0
財政	▲ 900		▲ 2,700			1,000
資金過不足	▲ 1,200		▲ 1,800			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			900	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					12,500	
国債買入	10,800				8,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 200	2,500	
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		700			
国債補完供給	▲ 2,300	500	2,300			
当預増減	8,000		400		24,500	
当座預金残高	3,605,900		3,606,300		3,630,800	
準備預金残高	3,190,800					
積み終了先	3,190,700				2月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,190,700				積数	
非準備預金先	415,100				1日平均	
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		99.99%		日数	
					90.32%	

●2018年2月9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1兆3,000億円増加の319兆4,000億円(当座預金残高見込みは361兆円)。本日の無担O/Nは今積み期最後の週末を挟む取引で4日積みということもあり、積みの調整から地銀業態を中心に取り上がる地合いとなった。朝方は地銀・証券業態で▲0.035~▲0.02%、信託業態で▲0.04%台の調達が見られた。一巡後は、一部地銀で取り残ったまま本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/13-2/14)は▲0.095~▲0.085%程度、S/N(2/14-2/15)は▲0.10~▲0.095%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2Y381~384、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、短国買入オペが12,500億円(前回比+5,000億円)でオファーされた。応札額は3兆円台と多かったものの、平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.002%と小じっかりとした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.159~▲0.155%、6M物が▲0.16~▲0.158%、1Y物が▲0.18~▲0.175%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、電機業態等から大型案件が見られたものの案件少なく、800億円程度の償還に対して発行は600億円程度であった。発行レートは引き続き0%近辺での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2018/2/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	0.050	▲ 0.034				-	▲ 0.090	0.065	▲ 0.010	21,382.62	▲ 508.24	108.55-57	109.15-16
T/N			0.000				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.130	▲ 0.006				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.025	0.020	▲ 0.003				-	▲ 0.095						
3W			0.030				-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.158	▲ 0.125						
6M							▲ 0.158	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.162						
									日付	2/2	2/5	2/6	2/7	2/8
									日銀当預残	3,612,200	3,592,100	3,609,400	3,608,900	3,597,900
									準備預金残	3,195,900	3,192,100	3,193,900	3,197,200	3,173,300
									マネタリーベース	4,693,900	4,672,800	4,689,300	4,688,200	4,677,400
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.044%	▲0.041%	▲0.038%	▲0.036%
									コール市場残高	111,375	103,416	101,924	102,842	110,547
									うち無担	88,915	80,622	79,901	80,650	88,374
									うちO/N	60,130	51,987	50,836	50,615	52,789
									うち有担	22,460	22,794	22,023	22,192	22,173

●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	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
国庫短期証券買入	12,500	2018/2/14			32,058	12,502	▲0.002		▲0.001	47.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/2/14			6,697	2,507	▲0.002		▲0.001	99.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/2/14			8,547	3,303	▲0.005		▲0.004	57.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/2/14			6,370	1,908	▲0.009		▲0.008	96.9
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/2/14			2,359	805	▲0.009		▲0.008	66.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	76,973	2018/2/9	2018/2/13		2,155	2,155		▲0.500	▲0.500	

●2018年2月12日の予定

*振替休日	*米国1月の財政収支
-------	------------

●2018年2月13日の予定

*1月の企業物価指数	*英国1月の消費者物価指数
------------	---------------

◆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