

Central Daily Market Report

2018年1月26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1月26日		2018年1月29日		2018年1月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		700		1,000	
財政	▲ 500		▲ 11,900		2,000	
資金過不足	▲ 700		▲ 11,200		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			1,300	▲ 1,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					7,500	
国債買入	9,700				8,200	
CP等買入		▲ 400		▲ 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	1,300					
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 800	800		800		
当預増減	9,900		▲ 10,800		18,700	
当座預金残高	3,679,800		3,669,000		3,687,700	
準備預金残高	3,239,900					
積み終了先	3,237,900					
超過準備	3,237,900				1月29日以降の残り所要積立額 積数 6,000	
非準備預金先	439,900				1日平均 300	
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額						3,066,300
準備預金進捗率	実績	99.80%	日数	41.94%		

●2018年1月26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6,000億円増の324兆円(当座預金残高見込みは368兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・証券業態を中心に▲0.04~▲0.035%での調達で始まった。週末要因により、▲0.035%まで取り上がる先が増えたものの、一巡後は軟調な展開となり、▲0.065~▲0.05%で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/29-1/30)は▲0.08~▲0.07%程度、S/N(1/30-1/31)は▲0.085~▲0.075%程度で出合いが見られた。T/N,S/Nともに投資家の資金調達意欲はしつかりの展開。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5Y134、10Y339、341、347、348、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、短国買入オペが事前予想通りの7,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。応札額が2兆円と多かったものの堅調なマーケットを反映し、平均落札利回較差▲0.002%、按分落札利回較差▲0.005%としっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.157~▲0.153%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は月末前倒し発行にあたり、不動産・鉄鋼・電力業態等、複数の銘柄でまとまった発行が見られ、償還総額600億円程度に対して、発行総額は3,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オペが事前予定から500億円増額され、2,500億円でおファーされた。前回は平均落札・按分レート共に0%だったが、入札結果は平均落札レートが0.001%と前回比で上昇、按分レートは▲0.001%と前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2018/1/26	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.080	0.070	▲ 0.010	23,631.88	▲ 37.61	109.67-69	109.03-04
T/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.080	0.021				-	▲ 0.083	日付	1/19	1/22	1/23	1/24	1/25
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.086	日銀当預残	3,670,100	3,655,800	3,676,500	3,666,800	3,669,900
3W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.014				-	▲ 0.091	準備預金残	3,232,800	3,246,400	3,251,600	3,228,200	3,229,400
1M			0.070				-	▲ 0.094	マネタリーベース	4,754,000	4,738,600	4,759,200	4,749,200	4,752,800
3M							▲ 0.156	▲ 0.117	無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.041%	▲ 0.041%	▲ 0.036%	▲ 0.041%
6M							▲ 0.137	▲ 0.145	コール市場残高	101,513	100,736	102,147	108,655	103,297
1Y							▲ 0.153	▲ 0.159	うち無担	77,921	77,258	79,123	85,429	79,781
									うちO/N	48,261	46,898	48,363	54,559	48,581
									うち有担	23,592	23,478	23,024	23,226	23,516

●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	7,500	2018/1/30			20,172	7,503	▲0.005		▲0.002	1.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/1/30			11,547	2,503	0.003		0.004	60.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/1/30			11,040	3,003	▲0.001		▲0.001	74.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/1/30			4,654	1,910	▲0.005		▲0.003	12.3
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/1/30			3,003	804	▲0.003		▲0.003	93.4
CP等買入	2,500	2018/1/31			7,630	2,485	▲0.001		0.001	10.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,360	2018/1/26	2018/1/29		806	806		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月29日の予定

*米国12月の個人所得・消費支出

◆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