

Central Daily Market Report

2018年1月23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1月23日		2018年1月24日		2018年1月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		500		▲ 1,000	
財政	1,100		▲ 9,000		5,000	
資金過不足	1,200		▲ 8,500		4,000	
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	12,500					
国債買入	7,100					
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				▲ 100		
E T F買入	600					
国債補完供給	▲ 1,100	500		1,100		
当預増減	20,700		▲ 7,700		4,000	
当座預金残高	3,676,500		3,668,800		3,672,800	
準備預金残高	3,251,600					
積み終了先	3,249,100				1月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,248,600				積数	16,300
非準備預金先	424,900				1日平均	700
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	99.47%	日数	25.81%		

●2018年1月23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2兆8,000億円増の325兆9,000億円(当座預金残高見込みは367兆7,000億円)。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。昨日と同様に、一巡後はレート水準がやや低下し、散発的に出合う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(1/24-1/25)は▲0.085~▲0.075%程度、S/N(1/25-1/26)は▲0.08~▲0.07%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っかりとの展開。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5Y133、134、10Y341、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動意なく閑散で、3M物が▲0.159%、1Y物が▲0.152%で出合った程度であった。

<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25日発行に当たり、鉄鋼・不動産・化学業態でまとまった発行が見られた。発行総額は2,300億円強に膨らみ、償還総額500億円程度を上回った。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/1/23	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.082	0.070	▲ 0.005	24,124.15	307.82	110.97-98	110.97-99
T/N			0.000				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.092						
1M			0.001				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.154	▲ 0.119						
6M							▲ 0.135	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.157						
									日付	1/16	1/17	1/18	1/19	1/22
									日銀当預残	3,674,300	3,686,500	3,663,100	3,670,100	3,655,800
									準備預金残	3,237,700	3,250,200	3,230,000	3,232,800	3,246,400
									マネタリーベース	4,761,000	4,771,800	4,747,800	4,754,000	4,738,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.042%	▲ 0.042%	▲ 0.041%	▲ 0.041%
									コール市場残高	99,697	96,217	95,838	101,513	100,736
									うち無担	73,937	73,056	71,737	77,921	77,258
									うちO/N	44,822	43,506	43,227	48,261	46,898
									うち有担	25,760	23,161	24,101	23,592	23,478

●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	募入最高利率	案分率	募入平均価格	募入平均利率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,756	2018/1/23	2018/1/24		1,116	1,116		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/1/23	2018/1/24		1	1		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/1/25	2018/2/1	1.92	1	1				

●2018年1月24日の予定

*11月の景気動向指数改訂状況	*12月の貿易統計	*米国12月の中古住宅販売	*交付税特別会計借入(10,500億円、2/1借入)
-----------------	-----------	---------------	----------------------------

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。買入れ額については、概ね現状程度の買入れペース(保有残高の増加額年間約80兆円)をめどとしつつ、金利操作方針を実現するよう運営する。 (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。 ●また、「貸出増加を支援するための資金供給」、「成長基盤強化を支援するための資金供給」、東日本大震災および熊本地震にかかる「被災地金融機関を支援するための資金供給オペレーション」等の措置について、受付期間を1年間延長することを決定(全員一致)。

◆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