

Central Daily Market Report

2018年2月16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16日		2018年2月19日		2018年2月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		200		0	
財政	▲ 24,600		▲ 3,600		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 25,000		▲ 3,400		▲ 20,000	
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			2,300	▲ 1,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,500			
CP等買入		▲ 100		▲ 100	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	800		600			
国債補完供給	▲ 700	500		700		
当預増減	▲ 24,500		9,200		▲ 17,500	
当座預金残高	3,659,700		3,668,900		3,651,400	
準備預金残高	3,225,800					
積み終了先	3,205,200					
超過準備	2,324,800					
非準備預金先	433,900					
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,753,600	
準備預金進捗率	実績	98.16%	日数	10.71%		

●2018年2月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は地銀業態より▲0.06~▲0.03%、証券業態より▲0.04%、都銀、信託業態より▲0.06%の調達で始まった。積み初日の取引のため取り急ぐ動きは見られず、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出会いが見られる程度で今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺での出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(2/19-2/20)は、▲0.10~▲0.095%程度での出会い。S/N(2/20-2/21)は、▲0.105~▲0.095%程度での出会い。引き続き投資家オファーが薄い中、業者の担保確保ニーズが強まったことから低位での出会いとなった。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、2Y384~385、5Y130~134、10Y336~349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、1Y(740回)の入札が実施された。WI取引において▲0.162~▲0.16%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1627%、按分落札利回▲0.1607%と引き続き強い結果となった。セカンダリーでは▲0.171~▲0.17%出会いと強含みで推移した。この他には、3M物が▲0.178~▲0.169%、6M物が▲0.162%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、五・十日発行にあたり、1,200億円弱の償還に対して、2,000億円強の発行が見られた。商社からは大型発行も実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、一部の四半期末越えの案件では積極的な水準での決着も見られた。

●短期金融市場関連指標

2018/2/16	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	▲ 0.042				-	▲ 0.094	0.055	▲ 0.005	21,720.25	255.27	106.09-11	106.01-02
T/N			0.000				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.024				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.109						
1M	▲ 0.025	0.060	▲ 0.016				-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.177	▲ 0.143						
6M							▲ 0.160	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.172	▲ 0.163						
									日付	2/8	2/9	2/13	2/14	2/15
									日銀当預残	3,597,900	3,605,900	3,604,500	3,623,400	3,684,200
									準備預金残	3,173,300	3,190,800	3,204,300	3,212,900	3,267,100
									マネタリーベース	4,677,400	4,685,800	4,683,800	4,701,800	4,763,000
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.034%	▲0.032%	▲0.029%	▲0.033%
									コール市場残高	110,547	122,442	110,778	112,079	110,543
									うち無担	88,374	99,921	89,127	89,712	88,706
									うちO/N	52,789	63,896	59,122	60,187	60,213
									うち有担	22,173	22,521	21,651	22,367	21,837

●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	740	-	23,000	2018/2/20	2019/2/20	108,264.0	18,671.8	100.1610	▲0.1607%	26.2068%	100.1630	▲0.1627%	4,328.0
流動性供給	255	-	4,000	2018/2/20		11,148.0	3,982.0		▲0.0060%		66.3730	▲0.0070%	
国有林野借入	-	-	960	2018/2/26	2023/2/25	2,951.0	960.00		0.0010%	100.0000%		0.0010%	

●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)	70,540	2018/2/16	2018/2/19		711	711		▲0.500	▲0.500	

●2018年2月19日の予定

*1月の貿易統計	*New York祝日 (Presidents' Day)
----------	-------------------------------

◆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