

# Central Daily Market Report

2018年2月19日(月)

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19日		2018年2月20日		2018年2月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 400	▲ 1,000			
財政	▲ 3,800	▲ 21,700	2,000			
資金過不足	▲ 3,700	▲ 22,100	1,000			
<b>金融調節</b>						
	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					7,500	
国債買入	10,500				3,700	
CP等買入		▲ 100	2,500	▲ 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						
E T F 買入	600		200			
国債補完供給	▲ 500	700	500			
当預増減	8,400	▲ 19,000	12,200			
当座預金残高	3,668,100	3,649,100	3,661,300			
準備預金残高	3,241,500					
積み終了先	3,227,200					
超過準備	3,224,000			2月20日以降の残り所要積立額	積数	33,300
非準備預金先	426,600			1日平均		1,400
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	98.79%	日数	14.29%		

## ●2018年2月19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▲0.065~▲0.025%、証券業態より▲0.055~▲0.045%、信託業態より▲0.07%の調達で始まった。一巡後はビッドが薄くなり、▲0.06%近辺の出合いが数件見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/20-2/21)は、▲0.10~▲0.09%程度での出合い。S/N(2/21-2/22)は、▲0.105~▲0.10%程度で出合い。S/Nは、引き続き投資家オファーが薄い中、買入れオペの実施を受けてか業者勢の担保確保ニーズが強まったことから低位での出合いとなった。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、短国買入オペが7,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。平均落札利回り較差+0.002%、按分落札利回り較差+0.001%と堅調な結果となった。マーケットでは3M物が▲0.183~▲0.178%、1Y物が▲0.169~▲0.167%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は小売業態からまとまった発行が見られたものの、全体の発行額は600億円程度と閑散。発行レートは概ね0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/19	無担(速報)			有担(速報)			短国 ※買入参考値	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	▲ 0.044				-	▲ 0.095	0.055	0.000	22,149.21	428.96	106.27-29	106.56-57
T/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.040	▲ 0.003				-	▲ 0.103						
2W	0.001	0.030	0.022				-	▲ 0.108						
3W	▲ 0.025	0.010	▲ 0.008				-	▲ 0.109						
1M			▲ 0.009				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.180	▲ 0.151						
6M							▲ 0.161	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.163						
									日付	2/9	2/13	2/14	2/15	2/16
									日銀当預残	3,605,900	3,604,500	3,623,400	3,684,200	3,659,700
									準備預金残	3,190,800	3,204,300	3,212,900	3,267,100	3,226,300
									マネタリーベース	4,685,800	4,683,800	4,701,800	4,763,000	4,738,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.034%	▲ 0.032%	▲ 0.029%	▲ 0.033%	▲ 0.042%
									コール市場残高	122,442	110,778	112,079	110,543	108,637
									うち無担	99,921	89,127	89,712	88,706	86,417
									うちO/N	63,896	59,122	60,187	60,213	60,079
									うち有担	22,521	21,651	22,367	21,837	22,220

## ●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	2018/2/21			21,635	7,502	0.001		0.002	79.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/2/21			6,650	1,916	0.003		0.004	33.6
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/2/21			2,765	802	0.002		0.003	98.9
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/2/21			2,092	1,003	▲ 0.060		▲ 0.220	52.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,861	2018/2/19	2018/2/20		330	330		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	4,672	2018/2/19	2018/2/20		163	163		▲ 0.500	▲ 0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第82回	2018/2/23	2019/2/22	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第21回	2018/2/23	2019/2/22	0

## ●2018年2月20日の予定

*流動性供給入札 (5,500億円、2/22発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、2/28借入)
------------------------------	---------------------------------

◆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