

# Central Daily Market Report

2018年2月20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2月20日		2018年2月21日		2018年2月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 22,100		200		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 22,400		▲ 700		▲ 7,000	
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			7,500			
国債買入			3,900			
CP等買入	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	200		100			
国債補完供給	▲ 600	500		600		
当預増減	▲ 19,900		11,400		▲ 7,000	
当座預金残高	3,648,200		3,659,600		3,652,600	
準備預金残高	3,212,800					
積み終了先	3,201,400					
超過準備	3,199,800					
非準備預金先	435,400					
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	99.26%	日数	17.86%		

## ●2018年2月20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▲0.06~▲0.045%、信託業態より▲0.07~▲0.065%の調達で始まった。一巡後は徐々にビッドが消え、▲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、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/21-2/22)は、▲0.10~▲0.09%程度での出合い。S/N(2/22-2/23)は、▲0.105~▲0.10%程度で出合い。S/Nは、引き続き業者勢の担保確保ニーズがしっかりしており、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動意なく閑散で、3M物が▲0.185~▲0.183%、WI取引で22日入札の3M物が▲0.175%で出合った程度であった。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は商社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700億円程度にとどまった。発行レートは期越えの銘柄でやや強めの出合いも見られたが、概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/20	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	▲ 0.045				-	▲ 0.094	0.060	0.005	21,925.10	▲ 224.11	106.71-72	106.97-98
T/N	0.000	0.035	0.024				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.108						
2W			▲ 0.002				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.110						
1M			0.010				-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.180	▲ 0.157						
6M							▲ 0.161	▲ 0.152						
1Y			0.080				▲ 0.168	▲ 0.165						
									日付	2/13	2/14	2/15	2/16	2/19
									日銀当預残	3,604,500	3,623,400	3,684,200	3,659,700	3,668,100
									準備預金残	3,204,300	3,212,900	3,267,100	3,226,300	3,241,500
									マネタリーベース	4,683,800	4,701,800	4,763,000	4,738,800	4,747,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.032%	▲ 0.029%	▲ 0.033%	▲ 0.042%	▲ 0.044%
									コール市場残高	110,778	112,079	110,543	108,637	105,146
									うち無担	89,127	89,712	88,706	86,417	81,011
									うちO/N	59,122	60,187	60,213	60,079	53,343
									うち有担	21,651	22,367	21,837	22,220	24,135

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
流動性供給	256	-	5,500	2018/2/22		20,874.0	5,489.0		0.0010%	25.0455%		▲0.0080%	
交付税特会	-	-	10,500	2018/2/28	2018/8/28	180,064.0	10,500.08		0.0000%	5.8314%		0.0000%	

## ●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	入札総額(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
社債等買入	1,000	2018/2/26			1,302	1,000	▲0.097		▲0.049	7.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,639	2018/2/20	2018/2/21		571	571		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	727	2018/2/20	2018/2/21		22	22		▲0.500	▲0.500	

## ●2018年2月21日の予定

\*布野日銀審議委員、松江支店開設100周年記念講演会にて講演  
\*月例経済報告

\*米国1月の中古住宅販売

◆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