

# Central Daily Market Report

2018年2月21日(水)

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21日		2018年2月22日		2018年2月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,700		▲ 2,000	
財政	1,100		▲ 9,500		1,000	
資金過不足	200		▲ 11,200		▲ 1,000	
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				10,300	
CP等買入				▲ 300		
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	100		100			
国債補完供給	▲ 200	600		200		
当預増減	12,100		▲ 11,200		9,300	
当座預金残高	3,660,300		3,649,100		3,658,400	
準備預金残高	3,223,300					
積み終了先	3,216,500		2月22日以降の残り所要積立額		積数 13,500	
超過準備	3,216,500		1日平均		600	
非準備預金先	437,000					
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	99.51%	日数	21.43%		

## ●2018年2月21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~▲0.03%、証券業態より▲0.06~▲0.05%、信託業態より▲0.07~▲0.065%の調達で始まった。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中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/22-2/23)は、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。S/N(2/23-2/26)は、▲0.11~▲0.10%程度で出会い。S/Nは、オファーが薄い中で、業者勢の担保確保ニーズがしっかりしており、低位横ばい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、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品薄感が強く、3M物が▲0.195~▲0.185%、WI取引で22日入札の3M物が▲0.17%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25日にかかる発行となり、機械、不動産、石油業態からまとまった発行が見られ総額2,300億円程度に膨らんだ。発行レートは一部の期越え銘柄で強めの出会いも見られたが、概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/21	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	▲ 0.048				-	▲ 0.096	0.051	▲ 0.009	21,970.81	45.71	107.38-39	107.77-79
T/N			0.000				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.040	0.003				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.028	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.020	0.020	▲ 0.007				-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.188	▲ 0.159						
6M							▲ 0.162	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.165						
									日付	2/14	2/15	2/16	2/19	2/20
									日銀当預残	3,623,400	3,684,200	3,659,700	3,668,100	3,648,200
									準備預金残	3,212,900	3,267,100	3,226,300	3,241,500	3,212,800
									マネタリーベース	4,701,800	4,763,000	4,738,800	4,747,100	4,727,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.033%	▲ 0.042%	▲ 0.044%	▲ 0.045%
									コール市場残高	112,079	110,543	108,637	105,146	108,638
									うち無担	89,712	88,706	86,417	81,011	85,617
									うちO/N	60,187	60,213	60,079	53,343	57,219
									うち有担	22,367	21,837	22,220	24,135	23,021

## ●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)	応募率(%)	落札最低額	落札最高利率	案分率	落札平均価格	落札平均利率	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	申込総額(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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/2/23			7,350	2,506	0.003		0.003	64.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/2/23			12,152	3,304	0.002		0.002	86.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/2/23			15,115	4,514	▲ 0.003		▲ 0.003	89.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,737	2018/2/21	2018/2/22		195	195		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	705	2018/2/21	2018/2/22		2	2		▲ 0.500	▲ 0.500	
米ドル資金供給		2018/2/23	2018/3/1	1.92	5	5				

## ●2018年2月22日の予定

*10-12月期の英GDP改定値	*国庫短期証券(741回)入札 (3ヶ月、44,000億円、2/26発行) *20年利付国債入札 (10,000億円、2/26発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、3/6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