

# Central Daily Market Report

2018年2月23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23日		2018年2月26日		2018年2月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		0		▲ 1,000	
財政	4,100		▲ 16,900		▲ 3,000	
資金過不足	2,900		▲ 16,900		▲ 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			1,300	▲ 800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					2,500	
国債買入	10,700				8,500	
CP等買入		▲ 500		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300	1,000			
E T F 買入			500			
国債補完供給	▲ 500	100		500		
当預増減	12,400		▲ 15,100		7,000	
当座預金残高	3,661,800		3,646,700		3,653,700	
準備預金残高	3,219,400					
積み終了先	3,218,900				2月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,217,600				積数 3,400	
非準備預金先	442,400				1日平均 200	
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	99.88%	日数	35.71%		

## ●2018年2月23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~▲0.06%の調達で始まった。週末の取引であるものの、レートを切り上げる動きは見られず、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、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%近辺の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/26-2/27)は、▲0.11~▲0.10%程度での出合い。S/N(2/27-2/28)は、▲0.12~▲0.11%程度での出合い。T/Nは、短国3M物の発行を受けた業者勢の売りが出てきたことから、前日比で上昇した。S/Nは、引き続き担保確保ニーズを反映して、レートは低位で推移した。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2,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差±0.00%、按分落札利回較差▲0.002%と品薄感を反映し、引き続き堅調な結果となった。マーケットでは3M物が▲0.198~▲0.18%、1Y物が▲0.18%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は月末の前倒し発行も含め、自動車、商社、ノンバンク業態からとまった発行が見られ、総額2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは発行頻度の低い銘柄で強めの出合いも見られたが、概ね横ばいで推移した。本日2,500億円で実施されたCP等買入オペは、平均落札レートこそ▲0.001%と前回比で上昇したものの、按分落札レートは▲0.007%と前回比で低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/2/23	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	0.040	▲ 0.046				-	▲ 0.108	0.045	▲ 0.005	21,892.78	156.34	106.84-85	107.02-03
T/N			0.000				-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.110	0.000				-	▲ 0.129						
2W	0.020	0.040	0.027				-	▲ 0.128						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.190	▲ 0.166						
6M							▲ 0.170	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.178	▲ 0.166						
									日付	2/16	2/19	2/20	2/21	2/22
									日銀当預残	3,659,700	3,668,100	3,648,200	3,660,300	3,649,400
									準備預金残	3,226,300	3,241,500	3,212,800	3,223,300	3,211,900
									マネタリーベース	4,738,800	4,747,100	4,727,500	4,740,600	4,731,300
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.044%	▲0.045%	▲0.048%	▲0.048%
									コール市場残高	108,637	105,146	108,638	107,625	106,980
									うち無担	86,417	81,011	85,617	86,531	84,284
									うちO/N	60,079	53,343	57,219	57,033	54,924
									うち有担	22,220	24,135	23,021	21,094	22,696

## ●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	2,500	2018/2/27			9,385	2,504	▲0.002		0.000	18.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/2/27			9,221	2,504	▲0.002		▲0.001	37.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/2/27			11,043	3,304	▲0.005		▲0.005	94.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/2/27			4,639	1,907	▲0.007		▲0.005	68.2
国債買入(残存期間25年超)	800	2018/2/27			2,813	804	▲0.013		▲0.011	16.2
CP等買入	2,500	2018/2/28			5,775	2,485	▲0.007		▲0.001	50.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	81,115	2018/2/23	2018/2/26		420	420		▲0.500	▲0.500	

## ●2018年2月26日の予定

\*12月の景気動向指数改訂状況

\*米国1月の新築一戸建て販売件数

◆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