

Central Daily Market Report

2018年2月26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26日		2018年2月27日		2018年2月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 800		▲ 400	
財政	▲ 17,100		4,200		4,700	
資金過不足	▲ 17,400		3,400		4,300	
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			8,800		5,300	
CP等買入		▲ 700		▲ 200	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	1,000					
E T F 買入	500		400			
国債補完供給	▲ 1,200	500		1,200		
当預増減	▲ 16,800		16,100		12,100	
当座預金残高	3,645,000		3,661,100		3,673,200	
準備預金残高	3,195,700					
積み終了先	3,195,300					
超過準備	3,195,200					
非準備預金先	449,300					
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	99.89%	日数	39.29%		

●2018年2月26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%の調達で始まった。引き続き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合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/27-2/28)は、▲0.120~▲0.110%程度の出合い。S/N(2/28-3/1)は、▲0.150~▲0.120%程度の出合い。月末初物となるS/Nは、オフアがやや出難く、前日比でレート低下した。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等にビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先S/Nは、月末初にあたり、レートは低下した。アウトライト市場では、動意なく閑散な中、3M物が▲0.20~▲0.195%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額1兆3,500億円程度に対して、発行総額は8,500億円程度と大きく償還超となった。発行日が月末となったことで幅広い業態からの調達は見られたが、大型の発行案件は限定的であった。発行レートは一部の期末越え物においては低下していたものの、それ以外は概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/2/26	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.111	0.045	0.000	22,153.63	260.85	107.07-09	106.54-55
T/N			0.000				-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.040	▲ 0.015				-	▲ 0.137						
2W							-	▲ 0.134						
3W							-	▲ 0.135						
1M			0.001				-	▲ 0.139						
3M							▲ 0.190	▲ 0.164						
6M							▲ 0.170	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.178	▲ 0.166						
									日付	2/19	2/20	2/21	2/22	2/23
									日銀当預残	3,668,100	3,648,200	3,660,300	3,649,400	3,661,800
									準備預金残	3,241,500	3,212,800	3,223,300	3,211,900	3,219,400
									マネタリーベース	4,747,100	4,727,500	4,740,600	4,731,300	4,745,000
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.045%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.046%
									コール市場残高	105,146	108,638	107,625	106,980	116,076
									うち無担	81,011	85,617	86,531	84,284	95,368
									うちO/N	53,343	57,219	57,033	54,924	58,168
									うち有担	24,135	23,021	21,094	22,696	20,708

●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	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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/2/28			1,446	500		0.002	0.017	
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,500	2018/2/28			18,279	4,507	0.000		0.000	87.6
国債買入(物価連動債)	250	2018/2/28			1,769	252	▲0.060		▲0.101	28.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	79,292	2018/2/26	2018/2/27		1,221	1,221		▲0.500	▲0.500	

●2018年2月27日の予定

*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(22,000億円、3/15発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、3/8借入)
*米国1月の耐久財新規受注		

◆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