

Central Daily Market Report

2018年2月27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27日		2018年2月28日		2018年3月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 500		▲ 1,000	
財政	3,100		5,700		▲ 10,000	
資金過不足	2,300		5,200		▲ 11,000	
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	2,500					
国債買入	8,800		5,300			
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 2,700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
E T F買入	400		200			
国債補完供給	▲ 200	1,200		200		
当預増減	14,800		10,500		▲ 11,000	
当座預金残高	3,659,800		3,670,300		3,659,300	
準備預金残高	3,209,000					
積み終了先	3,208,700				2月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,208,700				積数 2,500	
非準備預金先	450,800				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	99.91%	日数	42.86%		

●2018年2月27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▲0.07~▲0.03%、証券業態より▲0.06~▲0.055%、信託業態より▲0.07~▲0.065%の調達で始まった。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後は▲0.07%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%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(2/28-3/1)は、▲0.125~▲0.115%程度の出合い。S/N(3/1-3/2)は、▲0.110~▲0.105%程度の出合い。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.203~▲0.195%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は鉄鋼・海運等の業態において大型案件が見られ、償還総額1,300億円程度に対して発行総額は2,000億円強と発行超であった。月初発行の応当入札日としては比較的活況なマーケットとなった。発行レートは全般的に低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/2/27	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	▲ 0.048				-	▲ 0.116	0.040	▲ 0.005	22,389.86	236.23	107.06-08	107.01-02
T/N			0.000				-	▲ 0.116						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.030	0.100	▲ 0.017				-	▲ 0.124						
3W							-	▲ 0.126						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.192						
3M							▲ 0.191	▲ 0.165						
6M							▲ 0.170	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.178	▲ 0.166						
									日付	2/20	2/21	2/22	2/23	2/26
									日銀当預残	3,648,200	3,660,300	3,649,400	3,661,800	3,645,000
									準備預金残	3,212,800	3,223,300	3,211,900	3,219,400	3,196,900
									マネタリーベース	4,727,500	4,740,600	4,731,300	4,745,000	4,728,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.045%	▲ 0.048%	▲ 0.048%	▲ 0.046%	▲ 0.048%
									コール市場残高	108,638	107,625	106,980	116,076	110,580
									うち無担	85,617	86,531	84,284	95,368	89,632
									うちO/N	57,219	57,033	54,924	58,168	51,432
									うち有担	23,021	21,094	22,696	20,708	20,948

●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)	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非償格競争入札(億円)
2年利付国債	386	0.10%	22,000	2018/3/15	2020/3/15	103,870.0	17,795.0	100.5200	▲0.1590%	62.3573%	100.5220	▲0.1600%	4,198.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/3/8	2018/9/7	183,762.0	10,500.18		0.0000%	5.7515%		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	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	33,014	2018/2/27	2018/2/28		226	226		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/3/1	2018/3/8	1.91	3	3				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数	
成長基盤強化	本則第31回	2018/3/2	2022/3/2	0	4,008	45
成長基盤強化	ABL等特別第27期	2018/3/6	2022/3/4	0	28	2
成長基盤強化	小口特別第24期	2018/3/2	2022/3/2	0	7.83	6
成長基盤強化	米ドル特別第23期	2018/3/5	2019/3/5		1,250	20
成長基盤強化	米ドル特別第19期(借り換え)	2018/3/5	2019/3/5		3,945	43
成長基盤強化	米ドル特別第15期(借り換え)	2018/3/5	2019/3/5		209	15
成長基盤強化	米ドル特別第11期(借り換え)	2018/3/5	2019/3/5		7	6

●2018年2月28日の予定

- *1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想：前月比▲4.2%)
- *1月の商業動態統計速報
- *1月の住宅着工統計
- *米国10-12月期の米GDP改定値
- *米国2月のCB消費者信頼感指数
- *米国2月のシカゴPM景況感指数
- *ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値

◆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