

# Central Daily Market Report

2018年3月2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3月2日		2018年3月5日		2018年3月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		600		1,000	
財政	▲ 50,300		▲ 8,100		1,000	
資金過不足	▲ 50,500		▲ 7,500		2,000	
<b>金融調節</b>	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			2,300	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					2,500	
国債買入	8,700				10,600	
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)	4,000	▲ 3,700				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,600	1,400		1,600		
当預増減	▲ 41,800		▲ 6,200		15,100	
当座預金残高	3,613,300		3,607,100		3,622,200	
準備預金残高	3,168,700					
積み終了先	3,168,500					
超過準備	3,168,500				3月5日以降の残り所要積立額 積数 1,300	
非準備預金先	444,600				1日平均 100	
積み期間 (2/16~3/15) の所要準備額					2,750,600	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	60.71%		

## ●2018年3月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担コールO/N物は▲0.055%の寄り付き後、地銀、信託、証券業態を中心に▲0.070~▲0.030%の出合いが中心となった。税揚げ日にあたる週末の取引となったが特段調達ニーズの高まりは見られず、概ね横ばい圏で推移した。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.030%程度の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/5~3/6) は、▲0.105~▲0.095%程度の出合い。S/N(3/6~3/7) は、▲0.135~▲0.120%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、短国買入オペアが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回較差▲0.003%、按分落札利回較差▲0.007%としっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.212~▲0.210%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。発行市場は機械・卸売・その他金融業態において大型発行が実施され、償還総額760億円程度に対して、発行総額1,600億円と発行超の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

2018/3/2	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.111	0.065	0.015	21,181.64	▲ 542.83	106.16-18	105.73-75
T/N			0.000				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.018	▲ 0.028				-	▲ 0.143						
2W	▲ 0.025	0.050	▲ 0.010				-	▲ 0.146						
3W							-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.191						
3M			0.180				▲ 0.204	▲ 0.170						
6M							▲ 0.168	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.176	▲ 0.167						
									日付	2/23	2/26	2/27	2/28	3/1
									日銀当預残	3,661,800	3,645,000	3,659,800	3,668,000	3,655,100
									準備預金残	3,219,400	3,196,900	3,209,000	3,212,900	3,208,200
									マネタリーベース	4,745,000	4,728,400	4,744,000	4,752,700	4,740,800
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.053%	▲0.052%
									コール市場残高	116,076	110,580	104,449	99,706	108,667
									うち無担	95,368	89,632	84,325	78,882	90,057
									うちO/N	58,168	51,432	54,265	49,572	59,847
									うち有担	20,708	20,948	20,124	20,824	18,610

## ●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	2018/3/6			10,706	2,502	▲0.007		▲0.003	10.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/3/6			6,931	2,509	▲0.002		▲0.001	70.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/3/6			10,419	3,306	▲0.008		▲0.006	14.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/3/6			12,242	4,506	▲0.011		▲0.010	88.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/3/6			1,563	253	0.040		0.028	89.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	68,001	2018/3/2	2018/3/5		1,461	1,461		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/3/2	2018/3/5		20	20		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年3月5日の予定

*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国2月のISM非製造業景況指数
-------------------	-------------------

◆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