

# Central Daily Market Report

2018年3月5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3月5日<br>需給速報 | 2018年3月6日<br>需給予想 | 2018年3月7日<br>当社予想 |
|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 銀行券                     | 600               | 500               | 1,000             |
| 財政                      | ▲ 8,800           | 2,000             | 7,000             |
| 資金過不足                   | ▲ 8,200           | 2,500             | 8,000             |
| <b>金融調節</b>             |                   |                   |                   |
|                         | スタート              | エンド               | スタート              |
| 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                    |                   |                   | 10,800            |
| CP等買入                   |                   | ▲ 300             | ▲ 100             |
| 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                |                   |                   |                   |
| 国債補完供給                  | ▲ 200             | 1,600             | 200               |
| 当預増減                    | ▲ 7,100           | 15,900            | 8,000             |
| 当座預金残高                  | 3,606,200         | 3,622,100         | 3,630,100         |
| 準備預金残高                  | 3,167,600         |                   |                   |
| 積み終了先                   | 3,167,400         |                   |                   |
| 超過準備                    | 3,167,400         |                   |                   |
| 非準備預金先                  | 438,600           |                   |                   |
| 3月6日以降の残り所要積立額          |                   |                   |                   |
|                         |                   |                   | 積数                |
|                         |                   |                   | 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                | 99.96%            | 日数                |
|                         |                   |                   | 64.29%            |

## ●2018年3月5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▲0.060%の寄り付き後、地銀、証券業態を中心に▲0.070~▲0.030%程度の出合いと先週末比で概ね横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.070~▲0.030%で散発的に調整の出合い。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.030~▲0.025%の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/6~3/7) は、▲0.150~▲0.125%程度の出合い。S/N(3/7~3/8) は、▲0.170~▲0.150%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。アウトライ市場は動意なく閑散で、3M物が▲0.205%で出合った程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は700億円程度と若干の償還超であった。その他金融業態で大型案件が一部に見られたものの、案件数が少なく盛り上がり欠けるマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2018/3/5 | 無担(速報)  |       |         | 有担(速報) |    |    | 短期      | 東京<br>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        | 売買参考値     | 平均値       | 直近値       | 前日比       | 15時時点     | 前日比       |
| O/N      | ▲ 0.073 | 0.001 | ▲ 0.054 |        |    |    | -       | ▲ 0.117     | 0.040     | ▲ 0.025   |           | 21,042.09 | ▲ 139.55  | 105.55-57 | 105.39-40 |
| T/N      |         |       | 0.000   |        |    |    | -       | ▲ 0.141     |           |           |           |           |           |           |           |
| S/N      |         |       |         |        |    |    | -       | -           |           |           |           |           |           |           |           |
| 1W       | ▲ 0.030 | 0.040 | ▲ 0.025 |        |    |    | -       | ▲ 0.147     |           |           |           |           |           |           |           |
| 2W       |         |       | 0.070   |        |    |    | -       | ▲ 0.151     |           |           |           |           |           |           |           |
| 3W       |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.153     |           |           |           |           |           |           |           |
| 1M       |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.195     |           |           |           |           |           |           |           |
| 3M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.204 | ▲ 0.168     |           |           |           |           |           |           |           |
| 6M       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.165 | ▲ 0.157     |           |           |           |           |           |           |           |
| 1Y       |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.176 | ▲ 0.167     |           |           |           |           |           |           |           |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | 日付        | 2/26      | 2/27      | 2/28      | 3/1       | 3/2       |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | 日銀当預残     | 3,645,000 | 3,659,800 | 3,668,000 | 3,655,100 | 3,613,300 |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | 準備預金残     | 3,196,900 | 3,209,000 | 3,212,900 | 3,208,200 | 3,168,700 |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | マネタリーベース  | 4,728,400 | 4,744,000 | 4,752,700 | 4,740,800 | 4,669,100 |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.048%  | ▲ 0.048%  | ▲ 0.053%  | ▲ 0.052%  | ▲ 0.050%  |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | コール市場残高   | 110,580   | 104,449   | 99,706    | 108,667   | 119,640   |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | うち無担      | 89,632    | 84,325    | 78,882    | 90,057    | 95,602    |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | うちO/N     | 51,432    | 54,265    | 49,572    | 59,847    | 64,922    |
|          |         |       |         |        |    |    |         |             |           | うち有担      | 20,948    | 20,124    | 20,824    | 18,610    | 24,038    |

## ●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 |
|---------------------------|----------------|----------|----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 80,538         | 2018/3/5 | 2018/3/6 |      | 217           | 217           |                 | ▲0.600          | ▲0.600            |      |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | 3,468          | 2018/3/5 | 2018/3/6 |      | 3             | 3             |                 | ▲0.600          | ▲0.600            |      |

## ●2018年3月6日の予定

|                     |                            |
|---------------------|----------------------------|
| *米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫 | *30年利付国債入札(8,000億円、3/20発行) |
|---------------------|----------------------------|

◆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