

# Central Daily Market Report

2018年3月6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3月6日		2018年3月7日		2018年3月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		200		0	
財政	2,200		7,900		▲2,000	
資金過不足	2,700		8,100		▲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						
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		▲100		▲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				▲100		
E T F 買入			100			
国債補完供給		200				
当預増減	16,100		7,400		▲2,000	
当座預金残高	3,622,300		3,629,700		3,627,700	
準備預金残高	3,185,600					
積み終了先	3,185,500					
超過準備	3,185,500					
非準備預金先	436,700					
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	67.86%		

## ●2018年3月6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は前日比弱含みの展開。足許は▲0.065%の寄り付き後、地銀、証券業態を中心に▲0.075~▲0.035%の出合いが中心となった。一巡後は調整から▲0.075~▲0.040%の出合い。ターム物に関しては引き続き月内のショートタームで▲0.030%程度の出合い。

### <レポ市場>

GC T/N(3/7~3/8)は、▲0.180~▲0.150%程度の出合い。S/N(3/8~3/9)は、▲0.200~▲0.160%程度の出合い。T/N,S/Nともにレート変動が激しく▲0.100%を大きく下回る出合いが続いている。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は引き続き低位で推移した。アウトライト市場は6M物の入札を控え、様子見閑散で、3M物で▲0.203%の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額900億円程度に対して発行総額は200億円程度と償還超となり、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。本日はCP等買入オペが5,000億円度でオファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.007%・按分レート▲0.013%と、前回(平均▲0.001%・按分▲0.007%)比で低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/3/6	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	▲0.075	0.001	▲0.053				-	▲0.138	0.050	0.010	21,417.76	375.67	106.25-27	106.14-15
T/N			0.000				-	▲0.169						
S/N							-	-						
1W	▲0.030	0.050	▲0.008				-	▲0.171						
2W	▲0.025	0.000	▲0.017				-	▲0.177						
3W			0.035				-	▲0.178						
1M							-	▲0.213						
3M							▲0.203	▲0.170						
6M							▲0.162	▲0.159						
1Y							▲0.175	▲0.167						
									日付	2/27	2/28	3/1	3/2	3/5
									日銀当預残	3,659,800	3,668,000	3,655,100	3,613,300	3,606,200
									準備預金残	3,209,000	3,212,900	3,208,200	3,168,700	3,167,600
									マネタリーベース	4,744,000	4,752,700	4,740,800	4,669,100	4,691,400
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.053%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.054%
									コール市場残高	104,449	99,706	108,667	119,640	105,181
									うち無担	84,325	78,882	90,057	95,602	84,067
									うちO/N	54,265	49,572	59,847	64,922	52,987
									うち有担	20,124	20,824	18,610	24,038	21,114

## ●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非価格競争入札(億円)
30年利付国債	58	0.80%	8,000	2018/3/20	2048/3/20	27,408.0	6,471.00	101.1500	0.7530%	68.4310%	101.2100	0.7500%	1,521.0

## ●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
CP等買入	5,000	2018/3/9			7,865	4,988	▲0.013		▲0.007	48.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	5,957	2018/3/6	2018/3/7		0	0				
米ドル資金供給		2018/3/8	2018/3/15	1.93	2	2				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2018/3/7	2018/3/16		2	2		▲0.100	▲0.100	

## ●2018年3月7日の予定

- \*1月の景気動向指数速報
- \*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*米国ページブック
- \*米国1月の貿易収支
- \*米国1月の消費者信用残高
- \*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値
- \*国庫短期証券(743回)入札(6ヶ月、23,000億円、3/12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