

Central Daily Market Report

2018年3月13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13日 需給速報	2018年3月14日 需給予想	2018年3月15日 当社予想
銀行券	600	0	▲1,000
財政	1,900	▲1,300	▲17,000
資金過不足	2,500	▲1,300	▲18,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		7,500	
国債買入		7,800	
CP等買入	▲300	▲900	
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		300	
国債補完供給	100		
当預増減	2,300	13,400	▲18,000
当座預金残高	3,643,200	3,656,600	3,638,600
準備預金残高	3,214,600		
積み終了先	3,214,500		
超過準備	3,214,500		
非準備預金先	428,600		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			2,751,400
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			92.86%

●2018年3月13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物は更に弱含み。地銀、証券業態を中心に▲0.086~▲0.045%の出会いが中心となった。一巡後も▲0.080%台でまとまった出会いが見られるなど、レートは低下基調。午後は取り手が少なく閑散であった。ターム物は月内のショートタームで▲0.035%で出会い。

<レポ市場>

GC T/N(3/14-3/15)は▲0.125~▲0.110%程度、S/N(3/15-3/16)は▲0.140~▲0.125%程度で出会いが見られた。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5Y132~134、10Y334~349、20Y160~163、30Y57、40Y10など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で、3M物が▲0.170~▲0.169%で少額のみ出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、電気機器業態で900億円程度の大ロットの発行が見られた他、石油業態やゴム業態でもまとまった額の調達が行われ、発行総額は3,000億円程まで膨らんだが、償還の3,700億円弱を下回った。発行レートは全体的に低下基調となった。期越物では昨日に引続きマイナス圏でレートを深掘りする動きが見られた。一方、期内物や大ロットの物においても、ディーラーの玉確保ニーズは強く、浅いマイナスから0%までのレンジで決着した。本日はCP等買入オベが、5,000億円オファーされた。結果は平均落札レート▲0.032%、按分落札レート▲0.043%と、前回比(平均▲0.007%、按分▲0.013%)で平均、按分ともに低下した。前回6日のオベは応札額が7,865億円と比較的少なかったことから、今回も応札額が少なく足切が大きく流れる展開も予想されていたが、応札額は前回比約1.4倍の1兆1,292億円まで膨らみ、足切レートは一部で期待されていたほどには低下しなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/3/13	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲0.086	0.001	▲0.068					-	▲0.119	0.045	0.000	21,968.10	144.07	106.30-31	106.97-98
T/N			0.000					-	▲0.116						
S/N								-	-						
1W	▲0.050	0.010	▲0.030					-	▲0.147						
2W								-	▲0.148						
3W								-	▲0.192						
1M								-	▲0.182						
3M								▲0.176	▲0.168						
6M								▲0.156	▲0.155						
1Y								▲0.156	▲0.166						
										日付	3/6	3/7	3/8	3/9	3/12
										日銀当預残	3,622,300	3,630,600	3,633,000	3,648,500	3,640,900
										準備預金残	3,185,700	3,191,700	3,190,800	3,200,800	3,207,000
										マネタリーベース	4,706,900	4,715,000	4,717,700	4,733,000	4,724,300
										無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.055%	▲0.057%	▲0.061%	▲0.065%
										コール市場残高	108,728	109,207	115,016	106,757	102,904
										うち無担	90,919	89,920	90,913	88,630	83,676
										うちO/N	59,439	59,030	60,183	51,215	45,631
										うち有担	17,809	19,287	24,103	18,127	19,228

●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)
5年利付国債	135	0.10%	22,000	2018/3/20	2023/3/20	74,695.0	17,863.00	101.0400	▲0.1060%	67.4216%	101.0500	▲0.1080%	4,130.0

●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	2018/3/16			11,292	4,997	▲0.043		▲0.032	74.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	37,968	2018/3/13	2018/3/14		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2018/3/13	2018/3/14		10	10		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/3/15	2018/3/22	1.92	2	2				

●2018年3月14日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(1月22、23日分)
*1月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+5.6%)

*米国1月の企業在庫
*米国2月の生産者物価指数
*米国2月の小売売上高

◆本資料は信頼できるとさ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