

Central Daily Market Report

2018年3月15日(木)

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15日		2018年3月16日		2018年3月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 14,000		2,900		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 14,700		2,400		▲ 5,000	
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					1,400	▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,700			
CP等買入		▲ 800	5,000	▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			27,800	▲ 23,000		
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
ETF買入						
国債補充供給	▲ 200	500		200		
当預増減	▲ 15,400		22,800		▲ 5,900	
当座預金残高	3,639,900		3,662,700		3,656,800	
準備預金残高	3,210,700					
積み終了先	3,210,700				3月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,210,600				積数	3,052,900
非準備預金先	429,200				1日平均	98,500
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						3,052,900
準備預金進捗率	実績		0.00%	日数		0.00%

●2018年3月15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物は地銀、証券、都銀業態の調達で▲0.086~▲0.050%の出合いが中心となった。積み最終日に当たり調達に動く先も増えた模様であるが、レート水準を押し上げるまでには至らず、横ばい圏で推移した。一巡後は、調整から▲0.086~▲0.045%で出合いが散見された。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされ、結果は1,430億円の応札(期落ち分2,320億円)で未達となった。ターム物は月内のショートタームで▲0.035%の出合い。

<レポ市場>

GC T/N(3/16~3/19)は▲0.11~▲0.095%程度、S/N(3/19~3/20)は▲0.125~▲0.11%程度で出合いが見られた。S/Nの取引は短国3ヶ月物の発行日にあつたが、調達サイドが薄く、閑散だった。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5Y124、130、131、134、10Y341、342、343、348、349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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.15%から▲0.162%に買い進まれる展開となったものの、平均落札利回▲0.1539%、按分落札利回▲0.1423%と慎重姿勢の強まりを反映した結果となった。セカンダリーでは、▲0.156~▲0.148%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は機械、鉄鋼、ノンバンク業態でまとまった額の発行がみられ、発行総額は2,000億円程度と償還総額の1,100億円程度を上回った。引続き買いニーズは強く、期内物においてもレート上昇圧力は観測されず低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2018/3/15	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				-	▲ 0.102	0.040	▲ 0.005	21,803.95	26.66	106.16-17	106.08-09
T/N			0.000				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.230	▲ 0.006				-	▲ 0.125						
2W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.179						
3W							-	▲ 0.170						
1M							-	▲ 0.163						
3M							▲ 0.151	▲ 0.161						
6M							▲ 0.150	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.164						
									日付	3/8	3/9	3/12	3/13	3/14
									日銀当預残	3,633,000	3,648,500	3,640,900	3,643,200	3,655,300
									準備預金残	3,190,800	3,200,800	3,207,000	3,214,800	3,229,000
									マネタリーベース	4,717,700	4,733,000	4,724,300	4,726,000	4,738,100
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.061%	▲0.065%	▲0.068%	▲0.068%
									コール市場残高	115,016	106,757	102,904	95,725	104,191
									うち無担	90,913	88,630	83,676	76,823	83,338
									うちO/N	60,183	51,215	45,631	45,688	52,663
									うち有担	24,103	18,127	19,228	18,902	20,853

●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)
国庫短期証券	745	-	43,700	2018/3/19	2018/6/18	158,097.6	35,353.80	100.0355	▲0.1423%	60.5278%	100.0384	▲0.1539%	8,346.0
20年利付国債	164	0.50%	10,000	2018/3/20	2038/3/20	35,973.0	8,049.00	99.2000	0.5440%	83.3690%	99.2200	0.5430%	1,941.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2018/3/19	2018/4/2		1,430	1,430				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	48,269	2018/3/15	2018/3/16		197	197		▲0.600	▲0.600	

●2018年3月16日の予定

*月例経済報告	*米国2月の住宅着工件数 *米国2月の鉱工業生産・設備稼働率 *米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(746回)入札 (1年、23,000億円、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。

◆本資料は何ら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