

Central Daily Market Report

2018年3月19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19日 需給速報	2018年3月20日 需給予想	2018年3月22日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 800	▲ 1,000
財政	▲ 6,200	51,100	1,000
資金過不足	▲ 6,300	50,300	0
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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			7,500
国債買入		3,300	10,300
CP等買入		▲ 300	▲ 500
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)		▲ 20,300	
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	▲ 1,500
E T F 買入	400		
国債補完供給	▲ 200	800	200
当預増減	▲ 26,900	51,800	17,800
当座預金残高	3,635,500	3,687,300	3,705,100
準備預金残高	3,185,300		
積み終了先	3,162,200		3月20日以降の残り所要積立額
超過準備	3,158,200		積数
非準備預金先	450,200		1日平均
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	98.15%	日数
			12.90%

●2018年3月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は前日比横ばい。地銀、証券、信託業態の調達で▲0.080~▲0.045%での出合いが中心となった。一巡後は▲0.070%程度で散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物は月内のショートタームで▲0.035~▲0.030%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(3/20-3/22)は▲0.11~▲0.10%程度、S/N(3/22-3/23)は▲0.15~▲0.12%程度で出合いが見られた。S/Nは日銀オペが入り、業者の売物が減少している印象であった。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5Y133~135、10Y343、344、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、短国買入オペが事前予想通りの7,500億円(前回と同額)でオファーされた。平均落札利回り較差+0.004%、按分落札利回り較差+0.002%と落ち着いた結果となった。マーケットでは6M物が▲0.153~▲0.151%、1Y物が▲0.162~▲0.16%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は機械、小売、ノンバンク業態から大型案件が見られたが、3,000億円程度の償還に対して発行は2,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね0%近辺が中心であったが、一部期越え物についてはややレートを切り下げての発行が見られた。

●短期金融市場関連指標

2018/3/19	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	▲ 0.062				-	▲ 0.124	0.035	0.005	21,480.90	▲ 195.61	105.95-97	105.90-91
T/N			0.000				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.040	▲ 0.003				-	▲ 0.127						
2W							-	▲ 0.174						
3W							-	▲ 0.166						
1M							-	▲ 0.160						
3M							▲ 0.163	▲ 0.153						
6M							▲ 0.150	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.161	▲ 0.164						
									日付	3/12	3/13	3/14	3/15	3/16
									日銀当預残	3,640,900	3,643,200	3,655,300	3,639,900	3,662,400
									準備預金残	3,207,000	3,214,800	3,229,000	3,210,700	3,215,400
									マネタリーベース	4,724,300	4,726,000	4,738,100	4,723,300	4,746,200
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.069%	▲0.063%
									コール市場残高	102,904	95,725	104,191	115,035	118,890
									うち無担	83,676	76,823	83,338	89,446	96,014
									うちO/N	45,631	45,688	52,663	60,081	63,499
									うち有担	19,228	18,902	20,853	25,589	22,876

●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	7,500	2018/3/22			18,430	7,500	0.002		0.004	29.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/3/22			7,816	2,502	0.001		0.004	54.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/3/22			10,058	3,305	0.002		0.002	97.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/3/22			16,762	4,505	0.003		0.003	50.1
社債等買入	1,500	2018/3/26			3,500	1,500	▲0.158		▲0.078	45.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,002	2018/3/19	2018/3/20		207	207		▲0.600	▲0.600	

●2018年3月20日の予定

*米国FOMC(1日目)	*流動性供給入札
*英国2月の消費者物価指数	(5,500億円、3/23発行)

◆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