

# Central Daily Market Report

2018年3月20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20日 需給速報	2018年3月22日 需給予想	2018年3月23日 当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 1,500	▲ 2,000
財政	49,400	9,100	3,000
資金過不足	48,500	7,600	1,000
<b>金融調節</b>			
	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	3,300	10,400	
CP等買入		▲ 1,000	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	▲ 1,500	▲ 100	
E T F買入		900	
国債補完供給	▲ 100	200	100
当預増減	49,900	25,400	1,000
当座預金残高	3,685,400	3,710,800	3,711,800
準備預金残高	3,233,400		
積み終了先	3,227,300		3月22日以降の残り所要積立額
超過準備	3,218,100		積数 25,800
非準備預金先	452,000		1日平均 1,000
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	99.15%	日数 19.35%

## ●2018年3月20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▲0.085~▲0.045%での出合いが中心となった。一巡後は▲0.075~▲0.060%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%程度の出合いが見られていた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/22-3/23)は▲0.17~▲0.14%程度、S/N(3/23-3/26)は▲0.17~▲0.16%程度で出合いが見られた。T/N,S/Nともに業者の売物は限定的であった。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、347~350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な中、3M物が▲0.175%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、ノンバンク業態から大型案件が見られたものの、案件数が少なく、3,500億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、横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2018/3/20	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲ 0.085	0.020	▲ 0.061				-	▲ 0.117	0.035	0.000	21,380.97	▲ 99.93	106.01-03	106.44-45
T/N			0.000				-	▲ 0.154						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.026				-	▲ 0.164						
2W							-	▲ 0.236						
3W							-	▲ 0.200						
1M							-	▲ 0.178						
3M							▲ 0.164	▲ 0.160						
6M							▲ 0.150	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.161	▲ 0.165						
									日付	3/13	3/14	3/15	3/16	3/19
									日銀当預残	3,643,200	3,655,300	3,639,900	3,662,400	3,635,500
									準備預金残	3,214,800	3,229,000	3,210,700	3,215,400	3,185,300
									マネタリーベース	4,726,000	4,738,100	4,723,300	4,746,200	4,719,400
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.068%	▲0.069%	▲0.063%	▲0.062%
									コール市場残高	95,725	104,191	115,035	118,890	111,303
									うち無担	76,823	83,338	89,446	96,014	94,420
									うちO/N	45,688	52,663	60,081	63,499	61,845
									うち有担	18,902	20,853	25,589	22,876	16,883

## ●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)
流動性供給	258	-	5,500	2018/3/23		19,489.0	5,494.00		0.0010%	16.0946%		▲0.0020%	

## ●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)	124,825	2018/3/20	2018/3/22		63	63		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/3/22	2018/3/29	2.16	0	0				

## ●2018年3月21日の予定

*春分の日	*米国FOMC(2日目) *米国FRB経済見通し発表 *米国2月の中古住宅販売
-------	---

## ●2018年3月22日の予定

*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(747回)入札(3ヶ月、44,000億円、3/26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