

Central Daily Market Report

2018年3月22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22日		2018年3月23日		2018年3月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 900			0
財政	8,600		2,400			24,000
資金過不足	7,200		1,500			24,000
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					2,200	▲ 1,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入	10,400				7,100	
CP等買入		▲ 1,000		▲ 1,300		
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		▲ 100	1,500	
E T F買入	900		700			
国債補完供給	▲ 500	100		500		
当預増減	24,500		1,300			33,600
当座預金残高	3,709,900		3,711,200			3,744,800
準備預金残高	3,247,700					
積み終了先	3,244,300				3月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,243,900				積数	22,100
非準備預金先	462,200				1日平均	900
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	99.28%	日数	22.58%		

●2018年3月22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%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(3/23-3/26)は▲0.15~▲0.10%程度、S/N(3/26-3/27)は▲0.14~▲0.11%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、10Y340、341、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.155%から▲0.165%に買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1587%、按分落札利回▲0.1503%と概ね事前予想通りのしっかりした結果となった。セカンダリーでは、▲0.163~▲0.158%の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、3,000億円程度の償還に対して発行は1,400億円程度と償還超のマーケットであった。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

2018/3/22	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.120	0.030	▲ 0.005	21,591.99	211.02	105.92-94	105.68-70
T/N	▲ 0.010	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.283						
2W							-	▲ 0.232						
3W							-	▲ 0.198						
1M							-	▲ 0.176						
3M							▲ 0.159	▲ 0.159						
6M							▲ 0.150	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.161	▲ 0.164						
									日付	3/14	3/15	3/16	3/19	3/20
									日銀当預残	3,655,300	3,639,900	3,662,400	3,635,500	3,685,400
									準備預金残	3,229,000	3,210,700	3,215,400	3,185,300	3,233,400
									マネタリーベース	4,738,100	4,723,300	4,746,200	4,719,400	4,770,100
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.069%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.061%
									コール市場残高	104,191	115,035	118,890	111,303	108,682
									うち無担	83,338	89,446	96,014	94,420	88,708
									うちO/N	52,663	60,081	63,499	61,845	59,293
									うち有担	20,853	25,589	22,876	16,883	19,974

●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)	募入最低値	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	747	-	43,500	2018/3/26	2018/6/25	156,929.0	35,191.70	100.0375	▲0.1503%	52.6666%	100.0396	▲0.1587%	8,308.0

●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	2018/3/26	2018/4/9		2,152	2,152				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/3/26			10,969	4,509	▲0.004		▲0.003	7.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/3/26			4,843	1,911	▲0.004		▲0.003	2.8
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/3/26			2867	704	0.001		0.001	86.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	159,825	2018/3/22	2018/3/23		459	459		▲0.600	▲0.600	

●2018年3月23日の予定

*2月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+1.0%	*米国2月の新築一戸建て販売件数 *米国2月の耐久財新規受注
---	-----------------------------------

◆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