

Central Daily Market Report

2018年3月23日(金)

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23日 需給速報	2018年3月26日 需給予想	2018年3月27日 当社予想
銀行券	▲ 700	200	0
財政	400	21,900	11,000
資金過不足	▲ 300	22,100	11,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			2,200
国債買現			▲ 1,200
国債売現			
国庫短期証買入			2,500
国債買入			7,700
CP等買入	▲ 1,300		▲ 400
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	1,500	
E T F買入	700	700	
国債補充供給	▲ 500	500	500
当預増減	▲ 1,000	33,100	19,600
当座預金残高	3,708,900	3,742,000	3,761,600
準備預金残高	3,244,400		
積み終了先	3,243,200		3月26日以降の残り所要積立額
超過準備	3,241,800		積数 14,100
非準備預金先	464,500		1日平均 700
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	99.54%	日数 32.26%

●2018年3月23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▲0.086~▲0.045%での出合いが中心となった。一巡後は▲0.070%台で散発的な出合いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/26-3/27)は▲0.11~▲0.095%程度、S/N(3/27-3/28)は▲0.14~▲0.12%程度で出合いが見られた。TN.SNともに投資家の資金調達意欲は薄い。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、短国買入オペが事前予想通りの2,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差±0.000%、按分落札利回較差▲0.004%と好需給を反映し、小じっかりした結果となった。マーケットでは3M物が▲0.18~▲0.17%、1Y物が▲0.166~▲0.158%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、3,000億円程度の償還に対して発行は900億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

2018/3/23	無担(速報)			有担(速報)			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		
	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.086	0.030	▲ 0.064				-	▲ 0.111	0.015	▲ 0.015	20,617.86	▲ 974.13	104.96-97	105.01-03
T/N			0.000				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.325						
2W							-	▲ 0.249						
3W							-	▲ 0.200						
1M							-	▲ 0.177						
3M							▲ 0.174	▲ 0.160						
6M							▲ 0.150	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.165						
									日付	3/15	3/16	3/19	3/20	3/22
									日銀当預残	3,639,900	3,662,400	3,635,500	3,685,400	3,709,900
									準備預金残	3,210,700	3,215,400	3,185,300	3,233,400	3,248,700
									マネタリーベース	4,723,300	4,746,200	4,719,400	4,770,100	4,796,100
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.061%	▲0.063%
									コール市場残高	115,035	118,890	111,303	108,682	107,100
									うち無担	89,446	96,014	94,420	88,708	87,114
									うちO/N	60,081	63,499	61,845	59,293	57,154
									うち有担	25,589	22,876	16,883	19,974	19,986

●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	2,500	2018/3/27			6,301	2,501	▲0.004		0.000	46.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/3/27			8,214	2,504	0.002		0.003	11.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/3/27			10,483	3,308	▲0.005		▲0.004	47.6
国債買入(物価連動債)	250	2018/3/27			980	254	0.000		▲0.023	93.5
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	20,811	2018/3/23	2018/3/26		475	475		▲0.600	▲0.600	

●2018年3月26日の予定

*特にありません。

◆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