

# Central Daily Market Report

2018年3月26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26日 需給速報	2018年3月27日 需給予想	2018年3月28日 当社予想
銀行券	200	▲ 400	0
財政	20,100	5,600	▲ 4,000
資金過不足	20,300	5,200	▲ 4,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
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			2,500
国債買入	7,700	6,200	
CP等買入		▲ 400	▲ 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	1,500		
E T F買入	700		
国債補完供給	▲ 100	500	100
当預増減	31,200	13,600	▲ 4,000
当座預金残高	3,740,100	3,753,700	3,749,700
準備預金残高	3,280,800		
積み終了先	3,279,800	3月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,279,600	積数 13,000	
非準備預金先	459,300	1日平均 600	
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	99.57%	日数 35.48%

## ●2018年3月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は地銀、証券、信託業態の調達で▲0.086~▲0.045%での出会いが中心となった。一巡後は▲0.085~▲0.045%程度で散発的な出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った引合いも見られず、閑散とした状況だった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/27-3/28)は▲0.120~▲0.105%程度、S/N(3/28-3/29)は▲0.125~▲0.110%程度で出会いが見られた。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5Y130~135、10Y336~350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、閑散小動きな中、3M物が▲0.185%、6M物が▲0.17%で出合った程度だった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、3,500億円弱の償還に対して、500億円強の発行となり、化学、機械業態などから発行が実施された。発行レートはCPオベ見合いでの買い需要が剥落したこともあり、0%付近での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/3/26	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	売買差	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.030	▲ 0.064				-	▲ 0.112	0.020	0.005	20,766.10	148.24	104.83-85	105.06-07
T/N			0.000				-	▲ 0.114						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.345						
2W							-	▲ 0.246						
3W							-	▲ 0.197						
1M							-	▲ 0.178						
3M							▲ 0.177	▲ 0.160						
6M							▲ 0.153	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.166						
									日付	3/16	3/19	3/20	3/22	3/23
									日銀当預残	3,662,400	3,635,500	3,685,400	3,709,900	3,708,900
									準備預金残	3,215,400	3,185,300	3,233,400	3,248,700	3,244,400
									マネタリーベース	4,746,200	4,719,400	4,770,100	4,796,100	4,795,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.061%	▲ 0.063%	▲ 0.064%
									コール市場残高	118,890	111,303	108,682	107,100	117,098
									うち無担	96,014	94,420	88,708	87,114	95,257
									うちO/N	63,499	61,845	59,293	57,154	66,337
									うち有担	22,876	16,883	19,974	19,986	21,841

## ●入札結果

名称	回数	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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	99,235	2018/3/26	2018/3/27		86	86		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年3月27日の予定

*2月の企業向けサービス価格指数	*米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(5,000億円、3/29発行)
	*米国3月のCB消費者信頼感指数	

◆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