

# Central Daily Market Report

2018年3月27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27日		2018年3月28日		2018年3月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 300		▲ 1,000	
財政	5,900		▲ 800		7,000	
資金過不足	5,600		▲ 1,100		6,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入	6,200					
CP等買入		▲ 400		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入			200			
国債補完供給	▲ 1,300	100		1,300		
当預増減	12,700		▲ 500		6,000	
当座預金残高	3,752,800		3,752,300		3,758,300	
準備預金残高	3,294,200					
積み終了先	3,293,300				3月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,293,300				積数	
非準備預金先	458,600				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	99.60%	日数	38.71%		

## ●2018年3月27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%での出合いが中心となった。一巡後は調整から▲0.085~▲0.050%程度の出合いが散見された程度で、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(3/28-3/29)は▲0.105~▲0.095%程度、S/N(3/29-3/30)は▲0.115~▲0.110%程度で出合いが見られた。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.18%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、4,900億円程度の償還に対し、1,400億円弱の発行となり、石油業態からはまとまったロットの発行が実施された。発行レートは、期末の堅調な玉確保ニーズを反映し、一部銘柄で積極的な水準での決着も見られた。また、CP等買入オペアが前回比同額の5,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.029%、按分落札レート▲0.038%の決着といずれも前回比で上昇する結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/3/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.067				-	▲ 0.112	0.030	0.010	21,317.32	551.22	105.53-55	105.49-50
T/N			0.000				-	▲ 0.114						
S/N			0.005				-	-						
1W	0.040	0.170	0.138				-	▲ 0.353						
2W			0.030				-	▲ 0.249						
3W							-	▲ 0.198						
1M							-	▲ 0.179						
3M							▲ 0.177	▲ 0.162						
6M							▲ 0.153	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.166						
									日付	3/19	3/20	3/22	3/23	3/26
									日銀当預残	3,635,500	3,685,400	3,709,900	3,708,900	3,740,100
									準備預金残	3,185,300	3,233,400	3,248,700	3,244,400	3,280,800
									マネタリーベース	4,719,400	4,770,100	4,796,100	4,795,800	4,826,800
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.061%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%
									コール市場残高	111,303	108,682	107,100	117,098	112,947
									うち無担	94,420	88,708	87,114	95,257	90,652
									うちO/N	61,845	59,293	57,154	66,337	61,052
									うち有担	16,883	19,974	19,986	21,841	22,295

## ●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)
40年利付国債	10	0.90%	5,000	2018/3/29	2057/3/20	15,935.0	4,995.00	100.4900	0.8850%	20.6239%			

## ●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
CP等買入	5,000	2018/3/30			10,274	5,000	▲0.038		▲0.029	10.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	108,737	2018/3/27	2018/3/28		1,152	1,152		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	44,686	2018/3/27	2018/3/28		10	10		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/3/29	2018/4/5	2.15	0	0				

## ●2018年3月28日の予定

\*米国10-12月期のGDP確報値

◆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