

Central Daily Market Report

2018年2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2月23日 | | 2018年2月26日 | | 2018年2月27日 | |
|-----------------------|------------|--------|------------|--------|-----------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 1,200 | | 0 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | 4,100 | | ▲ 16,900 | | ▲ 3,000 | |
| 資金過不足 | 2,900 | | ▲ 16,900 | | ▲ 4,000 | |
| 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 | | | 1,300 | ▲ 800 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | 2,500 | |
| 国債買入 | 10,700 | | | | 8,500 | |
| CP等買入 | | ▲ 500 | | ▲ 700 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 300 | 1,000 | | | |
| E T F 買入 | | | 500 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 500 | 100 | | 500 | | |
| 当預増減 | 12,400 | | ▲ 15,100 | | 7,000 | |
| 当座預金残高 | 3,661,800 | | 3,646,700 | | 3,653,700 | |
| 準備預金残高 | 3,219,400 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,218,900 | | | | 2月26日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,217,600 | | | | 積数 3,400 | |
| 非準備預金先 | 442,400 | | | | 1日平均 200 | |
| 積み期間(2/16~3/15)の所要準備額 | | | | | 2,753,600 | |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.88% | 日数 | 35.71% | | |

●2018年2月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は地銀業態より▲0.065~▲0.03%、証券業態より▲0.06~▲0.05%、信託業態より▲0.07~▲0.06%の調達で始まった。週末の取引であるものの、レートを切り上げる動きは見られず、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られる中、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.03%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(2/26-2/27)は、▲0.11~▲0.10%程度での出合い。S/N(2/27-2/28)は、▲0.12~▲0.11%程度での出合い。T/Nは、短国3M物の発行を受けた業者勢の売りが出てきたことから、前日比で上昇した。S/Nは、引き続き担保確保ニーズを反映して、レートは低位で推移した。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、2Y384~385、5Y130~134、10Y336~349、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±0.00%、按分落札利回較差▲0.002%と品薄感を反映し、引き続き堅調な結果となった。マーケットでは3M物が▲0.198~▲0.18%、1Y物が▲0.18%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は月末の前倒し発行も含め、自動車、商社、ノンバンク業態からとまった発行が見られ、総額2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは発行頻度の低い銘柄で強めの出合いも見られたが、概ね横ばいで推移した。本日2,500億円で実施されたCP等買入オペは、平均落札レートこそ▲0.001%と前回比で上昇したものの、按分落札レートは▲0.007%と前回比で低下した。

●短期金融市場関連指標

| 2018/2/23 | 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 | ▲ 0.070 | 0.040 | ▲ 0.046 | | | | - | ▲ 0.108 | 0.045 | ▲ 0.005 | 21,892.78 | 156.34 | 106.84-85 | 107.02-03 |
| T/N | | | 0.000 | | | | - | ▲ 0.109 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.025 | 0.110 | 0.000 | | | | - | ▲ 0.129 | | | | | | |
| 2W | 0.020 | 0.040 | 0.027 | | | | - | ▲ 0.128 | | | | | | |
| 3W | | | ▲ 0.030 | | | | - | ▲ 0.130 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.135 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.190 | ▲ 0.166 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.170 | ▲ 0.155 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.178 | ▲ 0.166 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 2/16 | 2/19 | 2/20 | 2/21 | 2/22 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,659,700 | 3,668,100 | 3,648,200 | 3,660,300 | 3,649,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,226,300 | 3,241,500 | 3,212,800 | 3,223,300 | 3,211,900 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 4,738,800 | 4,747,100 | 4,727,500 | 4,740,600 | 4,731,300 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.042% | ▲0.044% | ▲0.045% | ▲0.048% | ▲0.048% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 108,637 | 105,146 | 108,638 | 107,625 | 106,980 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 86,417 | 81,011 | 85,617 | 86,531 | 84,284 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 60,079 | 53,343 | 57,219 | 57,033 | 54,924 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 22,220 | 24,135 | 23,021 | 21,094 | 22,696 |

●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 | 2018/2/27 | | | 9,385 | 2,504 | ▲0.002 | | 0.000 | 18.5 |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下) | 2,500 | 2018/2/27 | | | 9,221 | 2,504 | ▲0.002 | | ▲0.001 | 37.4 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 3,300 | 2018/2/27 | | | 11,043 | 3,304 | ▲0.005 | | ▲0.005 | 94.7 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 1,900 | 2018/2/27 | | | 4,639 | 1,907 | ▲0.007 | | ▲0.005 | 68.2 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 800 | 2018/2/27 | | | 2,813 | 804 | ▲0.013 | | ▲0.011 | 16.2 |
| CP等買入 | 2,500 | 2018/2/28 | | | 5,775 | 2,485 | ▲0.007 | | ▲0.001 | 50.0 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 81,115 | 2018/2/23 | 2018/2/26 | | 420 | 420 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |

●2018年2月26日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況

*米国1月の新築一戸建て販売件数

◆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