Central Daily Market Report

2018年2月28日（水）
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28日 需給速報		2018年3月1日 需給予想		2018年3月2日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 900		▲ 1,000	
財政	5,200		▲ 13,100		▲ 43,000	
資金過不足	4,600		▲ 14,000		▲ 44,000	
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						
国債買入	5,300				8,400	
CP等買入	2,500	▲ 2,700		▲ 200		
貸出支援基金(成)					4,000	▲ 400
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
ＥＴＦ買入	200					
国債補完供給	▲ 1,700	200		1,700		
当預増減	8,200		▲ 12,500		▲ 32,000	

当座預金残高	3,668,000	3,655,500	3,623,500
準備預金残高	3,212,900		
積み終了先	3,212,600		
超過準備	3,212,600		
非準備預金先	455,100		

3月1日以降の残り所要積立額	
積数	2,200
1日平均	100

積み期間（2/16～3/15）の所要準備額			2,750,600
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数 46.43%

●2018年2月28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▲0.07～▲0.03%、証券業態より▲0.065～▲0.06%、信託業態より▲0.07%の調達で始まった。月末要因でビッドを控える先もあり、出合いの水準は昨日と比べ低下した。一巡後は調整程度の調達が数件見られる程度で、今月の取引を終えた。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(3/1-3/2) は、▲0.140～▲0.130%程度の出合い。S/N(3/2-3/3) は、▲0.160～▲0.145%程度の出合い。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、2Y384～385、5Y130～134、10Y336～349等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物の入札を控え、様子見閑散な中、3M物が▲0.21～▲0.205%、WI取引で3M物が▲0.21%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は卸売・その他金融業態において大型案件が見られ、1,000億円強の発行となった。月の初旬における発行量としては多めであった。発行レートは全般的に低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/2/28	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				－	▲ 0.130
T/N			0.000				－	▲ 0.143
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.017				－	▲ 0.143
2W	▲ 0.028	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.143
3W							－	▲ 0.145
1M							－	▲ 0.200
3M							▲ 0.198	▲ 0.170
6M							▲ 0.170	▲ 0.157
1Y							▲ 0.178	▲ 0.167

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.045	0.005	22,068.24	▲ 321.62	107.43-44	107.07-08

日付	2/21	2/22	2/23	2/26	2/27
日銀当預残	3,660,300	3,649,400	3,661,800	3,645,000	3,659,800
準備預金残	3,223,300	3,211,900	3,219,400	3,196,900	3,209,000
マネタリーベース	4,740,600	4,731,300	4,745,000	4,728,400	4,744,000
無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.048%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%
コール市場残高	107,625	106,980	116,076	110,580	104,449
うち無担	86,531	84,284	95,368	89,632	84,325
うちO/N	57,033	54,924	58,168	51,432	54,265
うち有担	21,094	22,696	20,708	20,948	20,124

●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Ｉ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	2500	2018/3/2			7,767	2502	0.003		0.004	27.5
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3300	2018/3/2			11,404	3304	0.006		0.007	35.9
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,900	2018/3/2			5,534	1,910	0.002		0.003	66.9
国債買入（残存期間25年超）	700	2018/3/2			2596	704	0.002		0.003	58.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	64154	2018/2/28	2018/3/1		1587	1587		▲0.500	▲0.500	

●2018年3月1日の予定

*片岡日銀審議委員、
岡山県金融経済懇談会にて講演
*10-12月期の法人企業統計調査季報
*2月の消費動向調査
*米国1月の個人所得・消費支出
*米国2月のISM製造業景況指数
*国庫短期証券（742回）入札
（3ヶ月、44,000億円、3/5発行）
*10年利付国債入札（23,000億円、3/20発行）
*交付税特別会計借入（10,500億円、3/13借入）

◆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論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