

# Central Daily Market Report

2018年3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3月28日		2018年3月29日		2018年3月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 900		500	
財政	▲ 1,200		10,900		15,200	
資金過不足	▲ 1,300		10,000		15,700	
<b>金融調節</b>	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					3,100	
CP等買入		▲ 900		▲ 400	5,000	
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		500			
国債補完供給	▲ 200	1,300		200		
当預増減	▲ 900		10,300		23,800	
当座預金残高	3,751,900		3,762,200		3,786,000	
準備預金残高	3,294,400					
積み終了先	3,293,800		3月29日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,293,600		積数		11,300	
非準備預金先	457,500		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	99.63%	日数	41.94%		

## ●2018年3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、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▲0.070~▲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(3/29-3/30)は▲0.120~▲0.100%程度、S/N(3/30-4/2)は▲0.580~▲0.500%程度で出合いが見られた。S/Nは期末を跨ぐ取引となることからオファーが出難く、レートを大幅に切り下げた。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。アウトライ市場は、全般的に閑散な中、年度内最終受渡しの取引で、3M物が▲0.201~▲0.175%の強めの出合いが見られた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、四半期末の発行となり、電機、ゴム、石油業態等から大型発行案件が実施されたが、例年通り、3兆5,600億円程度の償還に対し、発行は6,300億円弱にとどまる大幅な償還超となった。発行レートは、償還の規模が大きかったこともあってディーラー・投資家の玉確保ニーズは底堅く、強めの水準での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/3/28	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.115	0.030	0.000	21,031.31	▲ 286.01	105.47-49	105.46-48
T/N	▲ 0.086	0.000	▲ 0.069				-	▲ 0.118						
S/N			▲ 0.086				-	-						
1W			0.010				-	▲ 0.351						
2W							-	▲ 0.249						
3W							-	▲ 0.197						
1M							-	▲ 0.178						
3M							▲ 0.178	▲ 0.162						
6M							▲ 0.152	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.166						
									日付	3/20	3/22	3/23	3/26	3/27
									日銀当預残	3,685,400	3,709,900	3,708,900	3,740,100	3,752,800
									準備預金残	3,233,400	3,248,700	3,244,400	3,280,800	3,294,200
									マネタリーベース	4,770,100	4,796,100	4,795,800	4,826,800	4,839,800
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.066%
									コール市場残高	108,682	107,100	117,098	112,947	111,565
									うち無担	88,708	87,114	95,257	90,652	92,336
									うちO/N	59,293	57,154	66,337	61,052	63,606
									うち有担	19,974	19,986	21,841	22,295	19,229

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/3/30			3,305	504	0.011		0.011	61.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/3/30			5,317	1,915	▲0.004		▲0.003	15.4
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/3/30			2,473	703	▲0.005		▲0.004	81.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	69,072	2018/3/28	2018/3/29		180	180		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年3月29日の予定

*2月の商業動態統計速報	*米国2月の個人所得・消費支出 *英国10-12月期のGDP確報値	*2年利付国債入札 (21,000億円、4/16発行)
--------------	--------------------------------------	--------------------------------

◆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