

Central Daily Market Report

2019年3月1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	2019年3月1日		2019年3月4日		2019年3月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		700		1,000	
財政	▲ 39,700		▲ 54,100		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 40,200		▲ 53,400		▲ 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			2,600	▲ 700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金(成)			2,900	▲ 5,100		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 40,400		▲ 53,700		▲ 4,000	
当座預金残高	3,814,300		3,760,600		3,756,600	
準備預金残高	3,354,400					
積み終了先	3,354,100				3月4日以降の残り所要積立額	
超過準備					積数 2,000	
非準備預金先	459,900				1日平均 200	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,818,000	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	57.14%		

●2019年3月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.08~▲0.02%の出合いが中心となった。月末要因の剥落から資金調達サイドの参加者が増加した。一巡後は▲0.08~▲0.04%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.04~▲0.03%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(3/1-3/4)は▲0.040~▲0.020%程度、T/N(3/4-3/5)は▲0.030~▲0.020%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10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61、40Y11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)は小幅上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.165~▲0.160%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1623%、按分落札利回▲0.1489%と按分レートがやや流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.159~▲0.155%出合いと底堅く推移した。この他に、6M物で▲0.215%、1Y物で▲0.202~▲0.200%で少額出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、電気機器業態で大型案件が実施され、発行総額1,000億円程度に対し、償還総額は1,100億円程度と若干の償還超のマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/3/1	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	▲ 0.049				-	▲ 0.034	▲ 0.015	0.015	21,602.69	217.53	111.35-37	111.81-82
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.029						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.032				-	▲ 0.038						
2W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.037				-	▲ 0.053						
3W							-	▲ 0.079						
1M			0.050				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.159	▲ 0.140						
6M							▲ 0.215	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.156						
									日付	2/22	2/25	2/26	2/27	2/28
									日銀当預残	3,835,000	3,847,400	3,846,100	3,838,500	3,854,700
									準備預金残	3,353,200	3,371,000	3,355,500	3,359,700	3,366,700
									マネタリーベース	4,951,100	4,963,900	4,963,500	4,956,900	4,974,200
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.054%
									コール市場残高	125,854	117,603	102,951	104,015	95,134
									うち無担	95,105	92,838	80,063	80,897	71,229
									うちO/N	59,120	56,743	53,823	54,327	48,119
									うち有担	30,749	24,765	22,888	23,118	23,905

●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)
国庫短期証券	817	-	43,600	2019/3/4	2019/6/10	141,435.0	35,264.9	100.0400	▲0.1489%	18.6666%	100.0436	▲0.1623%	8,335.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/3/4	2019/3/18		2,630	2,630				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	38,130	2019/3/1	2019/3/4		183	183		▲0.600	▲0.600	

●2019年3月4日の予定

*2月実績/3月見込み財政資金対民間取支	*米国12月の建設支出
*2月のマネタリーベース	

◆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