

Central Daily Market Report

2019年3月4日(月)

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4日 需給速報	2019年3月5日 需給予想	2019年3月6日 当社予想			
銀行券	500	▲ 100	1,000			
財政	▲ 52,800	▲ 3,900	▲ 16,000			
資金過不足	▲ 52,300	▲ 4,000	▲ 15,000			
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			10,100			
CP等買入		▲ 200	▲ 300			
貸出支援基金(成)	2,900	▲ 5,100				▲ 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				
当預増減	▲ 52,600	5,800	▲ 15,100			
当座預金残高	3,761,700	3,767,500	3,752,400			
準備預金残高	3,300,300					
積み終了先	3,300,100					
超過準備	3,300,100			3月5日以降の残り所要積立額 積数	1,700	
非準備預金先	461,400			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	99.94%	日数	60.71%		

●2019年3月4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~▲0.015%の出会いと先週末比で概ね横ばい圏で推移。一巡後は▲0.07~▲0.025%で散発的に調整の出会いが見られた。ターム物に関しては月内のショートターム物で出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(3/4-3/5)は▲0.035~▲0.030%程度、T/N(3/5-3/6)は▲0.030~▲0.025%程度 of 出会い。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、横ばい圏で推移した。アウトライ市場は動意なく閑散で、引け際に6M物が▲0.218%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、償還総額は1,300億円程度あったものの、小口の案件が散見された程度で、発行総額は100億円強にとどまった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/3/4	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.029	▲ 0.003	0.012	21,822.04	219.35	111.92-93	111.90-91
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.030						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.037						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.052						
3W							-	▲ 0.080						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.159	▲ 0.135						
6M							▲ 0.217	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.156						
									日付	2/25	2/26	2/27	2/28	3/1
									日銀当預残	3,847,400	3,846,100	3,838,500	3,854,700	3,814,300
									準備預金残	3,371,000	3,355,500	3,359,700	3,366,700	3,355,200
									マネタリーベース	4,963,900	4,963,500	4,956,900	4,974,200	4,934,400
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.054%	▲0.049%
									コール市場残高	117,603	102,951	104,015	95,134	119,389
									うち無担	92,838	80,063	80,897	71,229	97,553
									うちO/N	56,743	53,823	54,327	48,119	72,083
									うち有担	24,765	22,888	23,118	23,905	21,836

●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	業分率	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年超3年以下)	3,500	2019/3/5			11,218	3,501	0.001		0.002	32.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/3/5			13,277	4,006	0.005		0.006	30.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/3/5			5,997	1,815	0.013		0.014	43.7
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/3/5			1,992	502	0.017		0.018	40.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	27,312	2019/3/4	2019/3/5		10	10		▲0.500	▲0.500	

●2019年3月5日の予定

*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国12月の新築一戸建て販売件数 *米国1月の財政収支 *米国2月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札(22,000億円、3/6発行) *交付税特別会計借入(10,500億円、3/14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