

Central Daily Market Report

2019年3月5日(火)

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5日 需給速報	2019年3月6日 需給予想	2019年3月7日 当社予想
銀行券	▲ 100	300	0
財政	▲ 7,900	▲ 21,500	5,000
資金過不足	▲ 8,000	▲ 21,200	5,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		2,500	
国債買入	10,100		
CP等買入		▲ 300	▲ 200
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			
国債補完供給	▲ 500		500
当預増減	1,300	▲ 18,400	5,000
当座預金残高	3,763,000	3,744,600	3,749,600
準備預金残高	3,314,100		
積み終了先	3,313,900		
超過準備	3,313,900		
非準備預金先	448,900		
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	99.95%	日数
			64.29%

●2019年3月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.06~▲0.01%の出合い。昨日に続き資金調達サイドから取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.06~▲0.03%で調整の出合いが散見される中、本日の取引を終了した。ターム物に関しては月内のショートターム物で出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(3/5-3/6)は▲0.040~▲0.035%程度、T/N(3/6-3/7)は▲0.035~▲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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペアが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が12,981億円と多く、平均落札利回較差+0.032%、按分落札利回較差+0.031%と、引き続き在庫の積み上がり方を反映してか、弱めの結果となった。マーケットでは、特段の出合いは見られなかった。

<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、1,800億円強の償還に対して、1,700億円程度の発行が見られ、ノンバンクからは大口の発行が実施された。発行レートに変化は見られなかった。また、CP等買入オペアが3,500億円オファーされ、平均落札レート0.000%、按分落札レート▲0.006%といずれも前回は(平均0.005%、按分▲0.001%)で低下した。

●短期金融市場関連指標

2019/3/5	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	▲ 0.042				-	▲ 0.032	0.000	0.003	21,726.28	▲ 95.76	111.78-79	111.88-90
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.035						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.041						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.057						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.083						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.159	▲ 0.131						
6M							▲ 0.170	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.156						
									日付	2/26	2/27	2/28	3/1	3/4
									日銀当預残	3,846,100	3,838,500	3,854,700	3,814,300	3,761,700
									準備預金残	3,355,500	3,359,700	3,366,700	3,355,200	3,300,900
									マネタリーベース	4,963,500	4,956,900	4,974,200	4,934,400	4,881,200
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.050%	▲0.054%	▲0.049%	▲0.047%
									コール市場残高	102,951	104,015	95,134	119,389	107,960
									うち無担	80,063	80,897	71,229	97,553	86,549
									うちO/N	53,823	54,327	48,119	72,083	61,649
									うち有担	22,888	23,118	23,905	21,836	21,411

●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)
10年利付国債	353	0.10%	22,000	2019/3/6	2028/12/20	76,095.0	17,902.00	100.9800	0.0000%	74.5124%	101.0000	▲0.0020%	4,086.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/3/14	2019/9/13	269,234.0	10,500.10		0.0000%	3.9000%		0.0000%	

●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	2019/3/6			12,981	2,500	0.031		0.032	98.9
CP等買入	3,500	2019/3/8			7,665	3,492	▲0.006		0.000	30.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	11,921	2019/3/5	2019/3/6		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/3/5	2019/3/6		489	489		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2019/3/7	2019/3/14	2.91	2	2				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2019/3/6	2019/3/15		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2019年3月6日の予定

*原田日銀審議委員、山梨県金融経済懇談会にて講演	*米国ページブック
	*米国12月の貿易収支
	*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫

◆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