

Central Daily Market Report

2019年3月6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	2019年3月6日 需給速報	2019年3月7日 需給予想	2019年3月8日 当社予想
銀行券	300	▲ 600	0
財政	▲ 21,300	8,700	2,000
資金過不足	▲ 21,000	8,100	2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	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		5,200	
CP等買入		▲ 200	3,500
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	
当預増減	▲ 18,200	13,100	5,500
当座預金残高	3,744,800	3,757,900	3,763,400
準備預金残高	3,296,500		
積み終了先	3,296,300		
超過準備	3,296,300		
非準備預金先	448,300		
3月7日以降の残り所要積立額			
			積数 1,300
			1日平均 100
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 67.86%

●2019年3月6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▲0.055~▲0.01%の出会い。昨日よりも調達意欲は強く、一巡後も概ね横ばい圏で推移した。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(3/6-3/7)は▲0.035~▲0.020%程度、T/N(3/7-3/8)は▲0.035~▲0.030%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。アウトライト市場は6M物、3M物の入札を控えて閑散で、特段の出会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、償還総額2,500億円弱に対し、発行総額600億円弱にとどまる償還超となり、案件も少なく閑散であった。発行レートについて、特に目立った水準の変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/3/6	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	▲ 0.034				-	▲ 0.031	▲ 0.010	▲ 0.010	21,596.81	▲ 129.47	111.86-87	111.78-80
T/N	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.029				-	▲ 0.035						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.005	▲ 0.011				-	▲ 0.041						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.057						
3W							-	▲ 0.084						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.159	▲ 0.131						
6M							▲ 0.170	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.156						
									日付	2/27	2/28	3/1	3/4	3/5
									日銀当預残	3,838,500	3,854,700	3,814,300	3,761,700	3,763,000
									準備預金残	3,359,700	3,366,700	3,355,200	3,300,900	3,312,000
									マネタリーベース	4,956,900	4,974,200	4,934,400	4,881,200	4,882,700
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.054%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.042%
									コール市場残高	104,015	95,134	119,389	107,960	106,116
									うち無担	80,897	71,229	97,553	86,549	84,580
									うちO/N	54,327	48,119	72,083	61,649	59,230
									うち有担	23,118	23,905	21,836	21,411	21,536

●入札結果

名称	回数	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5年超10年以下)	4,800	2019/3/7			12,443	4,805	▲0.005		▲0.004	90.2
国債買入(物価連動債)	250	2019/3/7			1,394	253	0.030		▲0.024	50
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	59,266	2019/3/6	2019/3/7		0	0				

●2019年3月7日の予定

*1月の景気動向指数速報	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(818回)入札(6ヶ月、23,000億円、3/11発行)
*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国1月の消費者信用残高	*30年利付国債入札(7,000億円、3/8発行)
	*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値	

◆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