

Central Daily Market Report

2019年3月7日(木)

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7日		2019年3月8日		2019年3月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 200		1,000	
財政	9,700		▲ 6,800		▲ 2,000	
資金過不足	9,200		▲ 7,000		▲ 1,000	
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						▲ 4,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,200					
CP等買入		▲ 200	3,500	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	14,000		▲ 3,900		▲ 5,900	
当座預金残高	3,758,800		3,754,900		3,749,000	
準備預金残高	3,304,700					
積み終了先	3,304,600				3月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,304,600				積数 1,100	
非準備預金先	454,100				1日平均 100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,813,500	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	71.43%		

●2019年3月7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▲0.04~▲0.01%の出会い。ストレスチェックが複数の先から行われたため、0.001%で出会いが散見された。一巡後の出会い水準は▲0.05~▲0.03%程度で推移した。ターム物に関しては、特段出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(3/7-3/8)は▲0.040~▲0.035%程度、T/N(3/8-3/11)は▲0.035~▲0.025%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、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.148~▲0.140%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1435%、按分落札利回▲0.1375%とマーケットの慎重姿勢を反映してか、前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.141%出合いと堅調に推移した。

<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、ノンバンク・鉄鋼等から大型発行が実施されたが、3,700億円強の償還総額に対して、1,900億円弱の発行総額にとどまる償還超となった。発行レートは、一部期越え案件で積極的な買い姿勢も見られたが、概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2019/3/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.029				-	▲ 0.032	▲ 0.015	▲ 0.005	21,456.01	▲ 140.80	111.61-63	111.78-79
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.033						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.040						
2W			0.000				-	▲ 0.057						
3W							-	▲ 0.084						
1M							-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.159	▲ 0.131						
6M							▲ 0.141	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.156						
									日付	2/28	3/1	3/4	3/5	3/6
									日銀当預残	3,854,700	3,814,300	3,761,700	3,763,000	3,744,800
									準備預金残	3,366,700	3,355,200	3,300,900	3,312,000	3,296,600
									マネタリーベース	4,974,200	4,934,400	4,881,200	4,882,700	4,864,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.054%	▲ 0.049%	▲ 0.047%	▲ 0.042%	▲ 0.034%
									コール市場残高	95,134	119,389	107,960	106,116	107,130
									うち無担	71,229	97,553	86,549	84,580	85,650
									うちO/N	48,119	72,083	61,649	59,230	60,970
									うち有担	23,905	21,836	21,411	21,536	21,480

●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	818	-	23,000	2019/3/11	2019/9/10	87,480.0	18,690.8	100.0690	▲0.1375%	43.4054%	100.0720	▲0.1435%	4,309.0
30年利付国債	61	0.70%	7,000	2019/3/8	2048/12/20	25,850.0	5,668.0	101.9000	0.6240%	4.7619%	101.9700	0.6210%	1,321.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	140,200	2019/3/7	2019/3/8		141	141		▲0.500	▲0.500	

●2019年3月8日の予定

*10-12月期のGDP2次速報 (市場予想：前期比年率+1.8%)	*米国1月の卸売売上高 *米国2月の雇用統計	*国庫短期証券(819回)入札 (3ヶ月、43,400億円、3/11発行)
*1月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲0.4%)		*エネルギー対策借入 (4,000億円、3/20借入)
*1月の国際収支		
*2月の景気ウオッチャー調査		

◆本資料は信頼できるとさ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