

Central Daily Market Report

2019年3月8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8日		2019年3月11日		2019年3月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		800		1,000	
財政	▲ 7,900		▲ 7,900		2,000	
資金過不足	▲ 8,100		▲ 7,100		3,000	
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			4,800	▲ 4,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,100			
CP等買入	3,500	▲ 400		▲ 600		
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				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	▲ 5,200		500		3,000	
当座預金残高	3,753,600		3,754,100		3,757,100	
準備預金残高	3,314,500					
積み終了先	3,314,400				3月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,314,300				積数 700	
非準備預金先	439,100				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	99.98%	日数	82.14%		

●2019年3月8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▲0.035~▲0.01%の出会い。レポ金利の高止まりや週末要因などもあって引き続き調達意欲は強く、一巡後の出会い水準は▲0.035~▲0.02%程度で推移した。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.02%台で出会いが見られた。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物・15,000億円と1日物・20,000億円がオファーされた。2W物は4,781億円(期落ち額4,916億円)と札割れとなった。1日物には応募が無かった。1日物は、無担保コールレートがこのところ上昇していたため、短期金利がプラス圏とならない様、オファーされたと考えられる。

<レポ市場>

GC T/N(3/11-3/12)は▲0.025~0%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▲0.13%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1291%、按分落札利回▲0.1210%と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、▲0.12%で少額出会いと閑散小動きであった。この他に、6M物で▲0.140~▲0.135%の出会いが見られた。

<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、900億円程度の償還に対して、500億円程度の発行となり、石油業態からやや大口の発行が見られた程度であった。案件も少なく閑散とした展開に終始した。

●短期金融市場関連指標

2019/3/8	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	▲ 0.027				-	▲ 0.019	▲ 0.038	▲ 0.023	21,025.56	▲ 430.45	111.64-65	110.98-99
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.006						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.002	▲ 0.022				-	▲ 0.026						
2W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.052						
3W			0.030				-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.120	▲ 0.129						
6M							▲ 0.140	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.169	▲ 0.155						
									日付	3/1	3/4	3/5	3/6	3/7
									日銀当預残	3,814,300	3,761,700	3,763,000	3,744,800	3,758,800
									準備預金残	3,355,200	3,300,900	3,312,000	3,296,600	3,305,300
									マネタリーベース	4,934,400	4,881,200	4,882,700	4,864,100	4,878,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.049%	▲ 0.047%	▲ 0.042%	▲ 0.034%	▲ 0.029%
									コール市場残高	119,389	107,960	106,116	107,130	107,328
									うち無担	97,553	86,549	84,580	85,650	85,899
									うちO/N	72,083	61,649	59,230	60,970	62,419
									うち有担	21,836	21,411	21,536	21,480	21,429

●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	819	-	43,400	2019/3/11	2019/6/17	128,283.0	35,110.7	100.0325	▲0.1210%	48.4429%	100.0347	▲0.1291%	8,289.0
エネルギー対策	-	-	4,000	2019/3/20	2020/3/23	74,847.0	4,000.00		0.0000%	5.3443%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2019/3/11	2019/3/12		0	0				
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/3/11	2019/3/25		4,781	4,781				
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/3/11			1,729	500	0.100		0.113	50
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/3/11			11,592	3,506	0.000		0.001	42.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4000	2019/3/11			15,557	4,008	▲0.009		▲0.008	14.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24270	2019/3/8	2019/3/11		150	150		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/3/8	2019/3/11		24	24		▲0.500	▲0.500	

●2019年3月11日の予定

*2月のマネーストック	*米国12月の企業在庫
	*米国1月の小売売上高

◆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