

Central Daily Market Report

2019年3月12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12日		2019年3月13日		2019年3月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		400		0	
財政	5,600		▲ 21,400		2,000	
資金過不足	6,100		▲ 21,000		2,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			5,000			
国債買入						
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	▲ 800	1,000		800		
当預増減	6,000		▲ 15,400		2,000	
当座預金残高	3,757,600		3,742,200		3,744,200	
準備預金残高	3,295,800					
積み終了先	3,295,700					
超過準備	3,295,700				3月13日以降の残り所要積立額 積数 400	
非準備預金先	461,800				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	99.99%	日数	89.29%		

●2019年3月12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▲0.03~▲0.01%の出合い。引き続き調達ニーズの強い展開となり、一巡後もほぼ同水準の▲0.04~▲0.02%程度で推移した。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/13-3/14)は▲0.07~▲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、低下した。アウトライト市場では、短国買入オベが5,000億円(前日比+2,500億円)でオファーされた。応札額が17,732億円程度と多く、平均落札利回較差+0.016%、按分落札利回較差+0.012%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りからか、弱めの結果となった。マーケットでは、3M物で▲0.135%、6M物で▲0.149%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、小売業態等から大型案件が見られ、1,200億円程度の償還に対して、発行は1,500億円程度であった。CP等買入オベが3,500億円程度でオファーされた。結果は、按分落札レート▲0.011%・平均落札レート▲0.009%と按分、平均ともに前回(按分▲0.006%・平均0.000%)比で低下した。

●短期金融市場関連指標

2019/3/12	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	▲ 0.022				-	▲ 0.038	▲ 0.035	0.005	21,503.69	378.60	111.32-34	111.36-37
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.047						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.076						
2W	▲ 0.005	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.089						
3W			0.050				-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.135	▲ 0.131						
6M							▲ 0.148	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.189	▲ 0.154						
									日付	3/5	3/6	3/7	3/8	3/11
									日銀当預残	3,763,000	3,744,800	3,758,800	3,753,600	3,751,600
									準備預金残	3,312,000	3,296,600	3,305,300	3,314,600	3,291,200
									マネタリーベース	4,882,700	4,864,100	4,878,700	4,873,700	4,870,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.034%	▲ 0.029%	▲ 0.027%	▲ 0.024%
									コール市場残高	106,116	107,130	107,328	109,933	103,293
									うち無担	84,580	85,650	85,899	88,948	82,363
									うちO/N	59,230	60,970	62,419	61,618	55,203
									うち有担	21,536	21,480	21,429	20,985	20,930

●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)
5年利付国債	138	0.10%	20,000	2019/3/13	2023/12/20	76,603.0	16,255.00	101,2300	▲0.1550%	29.8196%	101.2400	▲0.1570%	3,735.0

●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
国庫短期証券買入	5,000	2019/3/13			17,732	5,001	0.012		0.016	13.5
CP等買入	3,500	2019/3/15			8,505	3,490	▲0.011		▲0.009	80.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	74,013	2019/3/12	2019/3/13		332	332		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	33,735	2019/3/12	2019/3/13		422	422		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2019/3/14	2019/3/22	2.9	3	3				

●2019年3月13日の予定

*1月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比%▲1.7%)
*1月の第3次産業活動指数
*2月の企業物価指数

*米国1月の耐久財新規受注
*米国2月の生産者物価指数

◆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