

Central Daily Market Report

2019年3月14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14日		2019年3月15日		2019年3月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 200		0	
財政	1,600		11,400		11,000	
資金過不足	1,300		11,200		11,000	
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						▲ 2,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,600					
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					37,700	▲ 44,000
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給		100				
当預増減	8,400		14,300		2,100	
当座預金残高	3,750,500		3,764,800		3,766,900	
準備預金残高	3,302,800					
積み終了先	3,302,700				3月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,302,700				積数	
非準備預金先	447,700				1日平均	
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	100.00%	日数	96.43%		

●2019年3月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日を明日に控え、邦銀を中心に▲0.03~▲0.002%と引き続き高い水準での出合いとなった。一巡後は▲0.05~▲0.03%で調整の出合いが見られた。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/N(3/15-3/18)は▲0.095~▲0.05%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)は積期最終日となり、低下した。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▲0.150~▲0.140%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1437%、按分落札利回▲0.1358%とWI取引の出合いを反映し、順調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.150~▲0.140%出合いと堅調に推移した。この他に、6M物で▲0.153%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、1,200億円程度の償還に対して、発行は期末越え物中心で1,000億円程度であった。発行レートは概ね0%近辺であったが、強めの決着となる銘柄も見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/3/14	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	▲ 0.023				-	▲ 0.055	▲ 0.045	0.005	21,287.02	▲ 3.22	111.20-21	111.59-60
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.230	0.021				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.126						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.150	▲ 0.133						
6M							▲ 0.153	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.189	▲ 0.155						
									日付	3/7	3/8	3/11	3/12	3/13
									日銀当預残	3,758,800	3,753,600	3,751,600	3,757,600	3,742,100
									準備預金残	3,305,300	3,314,600	3,291,200	3,297,200	3,291,900
									マネタリーベース	4,878,700	4,873,700	4,870,900	4,876,500	4,860,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.027%	▲ 0.024%	▲ 0.022%	▲ 0.021%
									コール市場残高	107,328	109,933	103,293	100,897	102,106
									うち無担	85,899	88,948	82,363	79,280	80,684
									うちO/N	62,419	61,618	55,203	58,120	59,534
									うち有担	21,429	20,985	20,930	21,617	21,422

●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	820	-	43,400	2019/3/18	2019/6/24	127,495.0	35,208.5	100.0365	▲0.1358%	77.5937%	100.0386	▲0.1437%	8,191.0
流動性供給	281	-	6,000	2019/3/15		15,969.0	5,988.0		0.0000%	25.1132%		▲0.0020%	

●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)	21,451	2019/3/14	2019/3/15		0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2019/3/18	2023/3/17	0	37,714

●2019年3月15日の予定

- *黒田日銀総裁、B20東京サミットにて講演
- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁定例会見
- *米国2月の鉱工業生産・設備稼働率
- *米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値

◆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