

Central Daily Market Report

2019年3月19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19日		2019年3月20日		2019年3月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,700		▲ 1,000	
財政	800		97,000		▲ 2,000	
資金過不足	200		95,300		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入	7,900					
CP等買入		▲ 200		▲ 1,200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 800		
E T F 買入	600		400			
国債補完供給	▲ 800	1,000		800		
当増減	11,200		94,500		▲ 3,000	
当座預金残高	3,786,900		3,881,400		3,878,400	
準備預金残高	3,310,400					
積み終了先	3,284,500		3月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,278,900		積数		62,000	
非準備預金先	476,500		1日平均		2,300	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,096,400	
準備預金進捗率	実績	98.00%	日数	12.90%		

●2019年3月19日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、積み期間の序盤のため、取り上がる先も見られず、立ち上がりは邦銀を中心に▲0.086~▲0.02%のビッドから始まった。朝方の出合い水準は▲0.06~▲0.015%のレンジが中心となり、一巡後は▲0.086~▲0.07%近辺と、ややレートを切り下げながら本日の取引を終了した。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(3/20-3/22)は▲0.135~▲0.09%程度の出合いだった。ビッドサイドが積極的で、ややレートが低下したが、引けにかけて再びオファーが残り気味の気配となった。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、小幅低下した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.168%から▲0.185%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1787%、按分落札利回▲0.1747%とWI取引を反映して強めの決着となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.185~▲0.180%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.168~▲0.163%で、6M物が▲0.165%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは同水準で推移した。発行市場は、ノンバンク業態で1,000億円弱、電気機器業態でも700億円程度の大規模案件がみられ、発行総額は2,900億円程度と償還総額2,500億円程度を上回った。発行レートは、一部残高の積みあがっている銘柄の期内物で若干上昇する動きが見られたものの、全般的には引き続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/3/19	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.104		▲ 0.050	▲ 0.010	21,566.85	▲ 17.65	111.38-39	111.26-28		
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.112									
S/N							-	-									
1W							-	▲ 0.117									
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.141									
3W							-	▲ 0.133									
1M							-	▲ 0.130									
3M							▲ 0.167	▲ 0.135									
6M							▲ 0.165	▲ 0.152									
1Y							▲ 0.182	▲ 0.155									
												日付	3/12	3/13	3/14	3/15	3/18
												日銀当預残	3,757,600	3,742,100	3,750,500	3,765,600	3,775,700
												準備預金残	3,297,200	3,291,900	3,303,200	3,294,700	3,297,600
												マネタリーベース	4,876,500	4,860,600	4,869,300	4,884,500	4,894,400
												無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.021%	▲ 0.023%	▲ 0.021%	▲ 0.051%
												コール市場残高	100,897	102,106	101,329	95,800	108,984
												うち無担	79,280	80,684	80,112	76,163	88,403
												うちO/N	58,120	59,534	58,262	56,293	67,563
												うち有担	21,617	21,422	21,217	19,637	20,581

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非償額競争入札(億円)
国庫短期証券	821	-	19,000	2019/3/20	2020/3/23	74,315.0	15,533.8	100.1770	▲0.1747%	35.1440%	100.1810	▲0.1787%	3,466.0
20年利付国債	167	0.50%	10,000	2019/3/20	2038/12/20	39,063.0	8,076.0	101.9500	0.3930%	14.9462%	101.9900	0.3910%	1,911.0

●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)	着札総額(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	平均着札レート・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)	34,795	2019/3/19	2019/3/20		715	715		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/3/19	2019/3/20		2	2		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第95回 2019/3/22	2020/3/19	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第34回 2019/3/22	2020/3/19	0	0

●2019年3月20日の予定

*月例経済報告	*米国FOMC(2日目)
*金融政策決定会合議事要旨(1月22、23日分)	*米国FRB経済見通し発表
	*英国2月の消費者物価指数

◆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選ばれる書面や目論見書をよくお読みください。