

Central Daily Market Report

2019年3月20日(水)

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20日		2019年3月22日		2019年3月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 800			0
財政	96,900		2,500			24,000
資金過不足	95,200		1,700			24,000
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,400			
CP等買入		▲ 1,200		▲ 1,100		
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		▲ 100		800
E T F買入	400		700			
国債補完供給	▲ 1,000	800		1,000		
当預増減	93,400		7,600			20,000
当座預金残高	3,880,300		3,887,900			3,907,900
準備預金残高	3,383,500					
積み終了先	3,372,900					
超過準備	3,366,600				3月22日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	496,800				積数	28,200
					1日平均	1,100
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	99.09%	日数	19.35%		

●2019年3月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日同様、大手行を中心に調達を見送る先も多く、低水準の取引が中心となった。立ち上がりは、地銀・信託・証券などから▲0.086~▲0.02%の幅広いレンジのビッドが始まった。出会い水準は、朝方は▲0.07~▲0.015%、一巡後は▲0.086~▲0.075%近辺と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、月内エンドの1W物では引き合いが散見されたものの、3月末を越える取引はオファーが出ず、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(3/22-3/25)は▲0.145~▲0.10%程度の出合いだった。前日に続いて運用サイドがしっかりしており、レートは小幅に低下した。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。アウトライト市場は、店頭見合いの買ひもあってか残存1~3ヶ月の銘柄が▲0.180%近辺での推移と強含む中、3M物が▲0.180%、6M物が▲0.180%で出合った。また、引け際に1Y物が▲0.193%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、石油・石炭や卸売業態でまとまった額の発行がみられ、発行総額は2,400億円程度まで膨らんだものの、償還総額3,000億円程度を下回った。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、一部の期越物でレートを切り下げる動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/3/20	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.107	▲ 0.040	0.010	21,608.92	42.07	111.41-42	111.59-60
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.143						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.139						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.161						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.138						
3M							▲ 0.185	▲ 0.137						
6M							▲ 0.180	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.193	▲ 0.156						
									日付	3/13	3/14	3/15	3/18	3/19
									日銀当預残	3,742,100	3,750,500	3,765,600	3,775,700	3,786,900
									準備預金残	3,291,900	3,303,200	3,294,700	3,297,600	3,311,600
									マネタリーベース	4,860,600	4,869,300	4,884,500	4,894,400	4,906,200
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.023%	▲0.021%	▲0.051%	▲0.053%
									コール市場残高	102,106	101,329	95,800	108,984	96,068
									うち無担	80,684	80,112	76,163	88,403	77,778
									うちO/N	59,534	58,262	56,293	67,563	57,033
									うち有担	21,422	21,217	19,637	20,581	18,290

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/3/22			1,134	500	▲0.026		▲0.017	94.7
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,800	2019/3/22			15,417	4,810	0.001		0.002	39.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	63,735	2019/3/20	2019/3/22		941	941		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/3/22	2019/3/28	2.9		1				

●2019年3月21日の予定

春分の日	*英中銀MPC結果発表
------	-------------

●2019年3月22日の予定

*2月の全国消費者物価指数(CPI)市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%	*米国1月の卸売売上高 *米国2月の中古住宅販売 *米国2月の財政収支	*国庫短期証券(822回)入札(3ヶ月、43,200億円、3/25発行) *流動性供給入札(4,000億円、3/25発行)
---	---	--

◆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