

Central Daily Market Report

2019年3月22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22日		2019年3月25日		2019年3月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 400			0
財政	▲ 400		22,700			6,000
資金過不足	▲ 1,300		22,300			6,000
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			5,100	▲ 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		▲ 1,100		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	800			
E T F 買入	700		400			
国債補完供給	▲ 900	1,000		900		
当預増減		3,700		23,900		6,000
当座預金残高		3,884,000		3,907,900		3,913,900
準備預金残高		3,390,300				
積み終了先		3,389,100			3月25日以降の残り所要積立額	14,300
超過準備		3,385,700			積数	600
非準備預金先		493,700			1日平均	600
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	99.54%	日数	29.03%	

●2019年3月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因によるレート上昇なども見られず、引き続き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で始まった。出合い水準は、朝方は▲0.075~▲0.02%、一巡後は▲0.086~▲0.07%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、年度末越えのオファーが限られていることから閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(3/25-3/26)は▲0.15~▲0.11%程度の出合いだった。短期3ヶ月物の入札があったが、運用サイドがしっかりしており、レートは前日からほぼ横ばい圏での取引だった。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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において玉確保の動きから▲0.205%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1958%、按分落札利回▲0.1824%と前回債からレートが低下する強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物が▲0.195~▲0.180%の出合いと若干軟調に推移した。この他に、1Y物が▲0.198~▲0.196%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、食品品業態、ノンバンク業態でまとまった額の発行がみられたものの、発行総額は1,500億円程度と償還総額1,900億円程度を下回った。発行レートは引き続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/3/22	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	▲ 0.061				-	▲ 0.127	▲ 0.075	▲ 0.035	21,627.34	18.42	110.81-82	110.76-77
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.031				-	▲ 0.202						
2W			0.030				-	▲ 0.166						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.180	▲ 0.138						
6M							▲ 0.180	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.198	▲ 0.156						
									日付	3/14	3/15	3/18	3/19	3/20
									日銀当預残	3,750,500	3,765,600	3,775,700	3,786,900	3,880,300
									準備預金残	3,303,200	3,294,700	3,297,600	3,311,600	3,385,100
									マネタリーベース	4,869,300	4,884,500	4,894,400	4,906,200	5,001,200
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.021%	▲0.051%	▲0.053%	▲0.059%
									コール市場残高	101,329	95,800	108,984	96,068	110,319
									うち無担	80,112	76,163	88,403	77,778	91,127
									うちO/N	58,262	56,293	67,563	57,033	68,202
									うち有担	21,217	19,637	20,581	18,290	19,192

●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	822	-	43,200	2019/3/25	2019/7/1	116,811.0	35,047.9	100.0490	▲0.1824%	45.4038%	100.0526	▲0.1958%	8,152.0
流動性供給	282	-	4,000	2019/3/25		17,636.0	3,996.0		▲0.0130%	40.1522%		▲0.0160%	

●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〉	15,000	2019/3/25	2019/4/8		5,131	5,131				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	109,657	2019/3/22	2019/3/25		919	919		▲0.600	▲0.600	

●2019年3月25日の予定

特にありません。

◆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