

# Central Daily Market Report

2019年3月27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27日		2019年3月28日		2019年3月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 1,100		▲ 1,300	
財政	▲ 9,700		29,400		11,100	
資金過不足	▲ 10,100		28,300		9,800	
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	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 400		▲ 1,300		3,500
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	300					
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 5,300		27,100		13,300	
当座預金残高	3,914,900		3,942,000		3,955,300	
準備預金残高	3,425,100					
積み終了先	3,423,600					
超過準備	3,423,600					
非準備預金先	489,800					
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	99.70%	日数			38.71%

## ●2019年3月27日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、引き続き各業態の資金余剰感が強く、低いレートでの取引が中心となった。朝方は地銀・信託・証券などからの調達を中心に▲0.086~▲0.015%の出会い、一巡後は▲0.086~▲0.07%近辺の出会い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、年度末越えの取引はオファーが限られていることに加え、4月スタートの引き合いについても動意は少なく、閑散な状況が続いた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(3/28-3/29)は、▲0.12~▲0.095%程度での出会い。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。10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61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、小幅上昇となった。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出会いは見られなかった。

### ＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は、例年通り年度末の有利子負債削減が見られたことで、償還総額4兆3,000億円程度に対して、発行総額は6,500億円程度と大幅な償還超となった。幅広い業態から大型発行案件が実施されたが、月末発行としては落ち着いたマーケットであった。発行レートは償還量が多かったこともあり、強めの水準での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/3/27	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	▲ 0.067				-	▲ 0.120	▲ 0.070	0.000	21,378.73	▲ 49.66	110.56-58	110.68-70
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.030	▲ 0.016				-	▲ 0.193						
2W	▲ 0.020	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.150						
3W							-	▲ 0.145						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.143						
3M							▲ 0.180	▲ 0.143						
6M							▲ 0.180	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.185	▲ 0.156						
									日付	3/19	3/20	3/22	3/25	3/26
									日銀当預残	3,786,900	3,880,300	3,884,000	3,905,600	3,920,200
									準備預金残	3,311,600	3,385,100	3,390,300	3,411,100	3,430,800
									マネタリーベース	4,906,200	5,001,200	5,005,900	5,027,500	5,042,500
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.059%	▲0.061%	▲0.062%	▲0.064%
									コール市場残高	96,068	110,319	110,169	102,837	102,083
									うち無担	77,778	91,127	96,130	88,873	89,570
									うちO/N	57,033	68,202	66,125	58,158	65,800
									うち有担	18,290	19,192	14,039	13,964	12,513

## ●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	業分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	18,699	2019/3/27	2019/3/28		101	101		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年3月28日の予定

*米国10-12月期のGDP確報値	*2年利付国債入札(20,000億円、4/1発行)
-------------------	---------------------------

◆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