

Central Daily Market Report

2019年3月29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29日		2019年4月1日		2019年4月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		700		1,000	
財政	3,500		▲ 28,900		▲ 12,000	
資金過不足	3,300		▲ 28,200		▲ 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			1,800	▲ 1,600		
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	3,500	▲ 4,300				
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	500					
国債補完供給	▲ 1,900	100	1,900			
当預増減	1,200		▲ 18,500		▲ 11,000	
当座預金残高	3,940,300		3,921,800		3,910,800	
準備預金残高	3,462,500					
積み終了先	3,462,300					
超過準備	3,460,300					
非準備預金先	477,800					
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,127,000	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	51.61%		

●2019年3月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、年度末を跨ぎ取引となることから調達を控える先が多く、低いレートでの取引が中心となる中、出し残るオファーも多く見られた。朝方は▲0.086~▲0.025%までの幅広いレンジでの出会いで始まったものの、一巡後は一段とビッドサイドが薄くなり、▲0.08%近辺で散発的な出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(4/1-4/2)は、▲0.105~▲0.085%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、レート上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.170%、6M物が▲0.160%、1Y物が▲0.190%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は3,300億円程度と発行超であった。卸売・建設・石油業態等業態から大玉の発行が見られ、月初旬の発行としては活況なマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/3/29	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	▲ 0.060				-	▲ 0.225	▲ 0.095	0.005	21,205.81	172.05	110.63-65	110.74-75
T/N							-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.033	▲ 0.045				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.032				-	▲ 0.098						
3W	▲ 0.013	▲ 0.005	▲ 0.011				-	▲ 0.117						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.170	▲ 0.138						
6M							▲ 0.160	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.157						
									日付	3/22	3/25	3/26	3/27	3/28
									日銀当預残	3,884,000	3,905,600	3,920,200	3,914,900	3,939,100
									準備預金残	3,390,300	3,411,100	3,430,800	3,425,100	3,444,900
									マネタリーベース	5,005,900	5,027,500	5,042,500	5,037,700	5,063,000
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.062%	▲0.064%	▲0.066%	▲0.067%
									コール市場残高	110,169	102,837	102,083	101,818	101,142
									うち無担	96,130	88,873	89,570	89,588	85,566
									うちO/N	66,125	58,158	65,800	64,758	61,361
									うち有担	14,039	13,964	12,513	12,230	15,576

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/4/1	2019/4/15		1,784	1,784				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/4/1			8,345	4,808	0.006		0.007	72.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/4/1			4,939	1,809	0.012		0.013	8.2
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/4/1			1,978	503	0.012		0.013	54.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	37,633	2019/3/29	2019/4/1		1,797	1,797		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月1日の予定

*新元号発表	*米国1月の企業在庫	*米国2月の小売売上高
*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国2月の建設支出	*米国3月のISM製造業景況指数
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+14	*ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値	

◆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