

Central Daily Market Report

2020年3月2日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2020年3月2日 需給速報	2020年3月3日 需給予想	2020年3月4日 当社予想
銀行券	200	▲ 400	0
財政	▲ 42,700	▲ 18,600	▲ 66,000
資金過不足	▲ 42,500	▲ 19,000	▲ 66,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	3,100		
国債買現		5,600	
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 200	
貸出支援基金(成)			2,200
貸出支援基金(貸)			▲ 6,300
被災地支援 社債等買入			▲ 600
E T F 買入	200	700	
国債補完供給	▲ 500	200	500
当預増減	▲ 39,700	▲ 12,800	▲ 70,100
当座預金残高	3,978,700	3,965,900	3,895,800
準備預金残高	3,465,100		
積み終了先	3,464,700		
超過準備	3,464,200		
非準備預金先	513,600		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,026,800
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数
			55.17%

●2020年3月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末要因が剥落しビッドが増加した事で、再び調達ニーズが高まった。立ち上がりは、邦銀を中心に▲0.025~▲0.005%近辺の出合いが見られた。一巡後も同水準のレートで散発的な出合いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、オファーサイドが少なく閑散なマーケットとなった。

<レポ市場>

GC T/N(3/3-3/4)は、▲0.075~▲0.055%程度での出合い。また、国債買現先オペ(3/16エンド)が5,000億円で約4年振りにオファーされた。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2Y402~409、5Y136~142、10Y335~357、20Y167~171、30Y59~65、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に6M物が▲0.225%、1Y物が▲0.234~▲0.220%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額100億円程度に対して、発行総額は1,100億円程度と発行超であった。一部のその他金融業態において大型発行があり、月初日の入札としてはやや活況であった。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

2020/3/2	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.073	▲ 0.140	0.020	21,344.08	201.12	107.68-69	108.44-45
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.002	▲ 0.009				-	▲ 0.072						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.074						
3W			0.000				-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.199	▲ 0.103						
6M							▲ 0.225	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.234	▲ 0.160						
									日付	2/21	2/25	2/26	2/27	2/28
									日銀当預残	3,986,300	3,998,400	3,999,300	3,999,500	4,018,400
									準備預金残	3,462,000	3,482,400	3,482,400	3,482,400	3,494,800
									マネタリーベース	5,124,600	5,137,100	5,138,300	5,139,900	5,158,900
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.012%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.025%
									コール市場残高	132,053	119,700	121,883	119,208	125,935
									うち無担	111,697	100,310	100,119	98,965	104,106
									うちO/N	79,574	67,617	69,611	68,152	75,283
									うち有担	20,356	19,390	21,764	20,243	21,829

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/2	2020/3/3	▲ 0.350	486	486		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/2	2020/3/3	▲ 0.350	0	0				
国債買現先	5,000	2020/3/3	2020/3/16		5,710	5,000	▲ 0.100		▲ 0.092	64.5

●2020年3月3日の予定

*2月のマネタリーベース	*ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札(21,000億円、3/4発行)
*2月の消費動向調査		
*2月実績/3月見込み財政資金対民間収支		

◆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