

Central Daily Market Report

2020年3月3日(火)

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3日 需給速報		2020年3月4日 需給予想		2020年3月5日 当社予想	
銀行券	▲ 400		100			0
財政	▲ 19,200		▲ 70,900			6,000
資金過不足	▲ 19,600		▲ 70,800			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						
国債買現	5,600		1,600			
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)			2,200	▲ 3,500		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 600				
E T F 買入	700		100			
国債補完供給	▲ 1,000	500	1,000			
当預増減	▲ 14,400		▲ 64,500			6,000
当座預金残高	3,964,300		3,899,800			3,905,800
準備預金残高	3,446,300					
積み終了先	3,445,900				3月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,445,900				積数	2,700
非準備預金先	518,000				1日平均	200
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	99.91%	日数	58.62%		

●2020年3月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.03~▲0.01%近辺での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強いものの、一部で調達レートを切り下げる動きも見られたことから、加重平均レートは前日比で若干低下した。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(3/4-3/5)は、▲0.150~▲0.095%程度での出合い。また、本日も国債買現先オペ(3/16エンド)が5,000億円でオファーされた。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。アウトライ市場は、短国買入オペが5,000億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.016%、按分落札利回較差+0.011%と、在庫調整の売りからか、弱めの結果となった。マーケットでは、6M物が▲0.222~▲0.215%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1,500億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超であった。5・10日発行となり鉄鋼・石油業態において大型案件が見られ比較的活況なマーケットとなった。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

2020/3/3	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	▲ 0.024				-	▲ 0.083	▲ 0.115	0.025	21,082.73	▲ 261.35	108.51-52	108.03-05
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.002	0.001				-	▲ 0.094						
2W			0.000				-	▲ 0.096						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.199	▲ 0.115						
6M							▲ 0.220	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.234	▲ 0.164						
									日付	2/25	2/26	2/27	2/28	3/2
									日銀当預残	3,998,400	3,999,300	3,999,500	4,018,400	3,978,700
									準備預金残	3,482,400	3,482,400	3,482,400	3,494,800	3,466,400
									マネタリーベース	5,137,100	5,138,300	5,139,900	5,158,900	5,118,900
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.025%	▲0.023%
									コール市場残高	119,700	121,883	119,208	125,935	138,202
									うち無担	100,310	100,119	98,965	104,106	119,463
									うちO/N	67,617	69,611	68,152	75,283	86,845
									うち有担	19,390	21,764	20,243	21,829	18,739

●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)
10年利付国債	357	0.10%	21,000	2020/3/4	2029/12/20	54,718.0	17,097.00	101.8400	▲0.0860%	28.9846%	101.9800	▲0.1000%	3,897.0

●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
国庫短期証券買入	5,000	2020/3/4			17,947	5,002	0.011		0.016	11.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/3	2020/3/4	▲ 0.350	986	986		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/3/5	2020/3/12	1.930	0	0				
国債買現先	5,000	2020/3/4	2020/3/16		1,500	1,500		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年3月4日の予定

*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国ページブック *2月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (11,650億円、3/13借入)
-------------------	------------------------------	---------------------------------

◆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