

Central Daily Market Report

2020年3月4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	2020年3月4日 需給速報	2020年3月5日 需給予想	2020年3月6日 当社予想			
銀行券	100	▲ 500	▲ 1,000			
財政	▲ 71,000	2,200	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 70,900	1,700	▲ 2,000			
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	1,600					
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			8,300			
CP等買入		▲ 100	▲ 100			
貸出支援基金(成)	2,200	▲ 3,500				▲ 100
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			▲ 100			
E T F 買入	100					
国債補完供給	▲ 400	1,000	400			
当預増減	▲ 65,000	10,200	▲ 2,100			
当座預金残高	3,899,300	3,909,500	3,907,400			
準備預金残高	3,390,100					
積み終了先	3,389,800			3月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,389,700			積数	2,300	
非準備預金先	509,200			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	99.92%	日数	62.07%		

●2020年3月4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▲0.04~▲0.01%近辺での調達で始まった。税揚げ日であったものの調達意欲は昨日より弱く、一巡後は▲0.05~▲0.02%近辺で散發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、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(3/5-3/6)は、▲0.155~▲0.10%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。個別銘柄では2Y402~410、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、3M物が▲0.205~▲0.195%、1Y物が▲0.250%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1,000億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と発行超であった。機械・不動産等の業態において大型案件が見られ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。本日はCP等買入オペアが、事前予定よりも500億円増額され4,000億円でおファーされた。入札結果は平均落札レート0.002%・按分レート▲0.001%と、前回(平均0.000%・按分▲0.001%)比で平均レートが上昇した。

●短期金融市場関連指標

2020/3/4	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.107	▲ 0.145	▲ 0.030	21,100.06	17.33	107.06-07	107.52-54
T/N	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.014				-	▲ 0.152						
S/N							-	-						
1W			0.003				-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.146						
3W			0.000				-	▲ 0.145						
1M							-	▲ 0.160						
3M							▲ 0.200	▲ 0.162						
6M							▲ 0.220	▲ 0.167						
1Y							▲ 0.250	▲ 0.178						
									日付	2/26	2/27	2/28	3/2	3/3
									日銀当預残	3,999,300	3,999,500	4,018,400	3,978,700	3,964,300
									準備預金残	3,482,400	3,482,400	3,494,800	3,466,400	3,446,500
									マネタリーベース	5,138,300	5,139,900	5,158,900	5,118,900	5,104,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.025%	▲ 0.023%	▲ 0.024%
									コール市場残高	121,883	119,208	125,935	138,202	135,465
									うち無担	100,119	98,965	104,106	119,463	117,109
									うちO/N	69,611	68,152	75,283	86,845	73,761
									うち有担	21,764	20,243	21,829	18,739	18,356

●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非償格競争入札(億円)	非償格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	11,650	2020/3/13	2020/9/11	257,357.0	11,640.01		0.0000%	4.5230%		0.0000%		10.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2020/3/5			1,397	502	▲0.013		▲0.003	71.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/3/5			13,206	4,201	▲0.045		▲0.043	74.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/3/5			11,381	3,405	▲0.067		▲0.063	54.8
CP等買入	4,000	2020/3/9			11,090	3,994	▲0.001		0.002	50.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/4	2020/3/5	-0.35	341	341		▲0.350	▲0.350	

●2020年3月5日の予定

*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫

*30年利付国債入札
(7,000億円、3/6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