

Central Daily Market Report

2020年3月5日(木)

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5日		2020年3月6日		2020年3月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500	0				1,000
財政	3,300		900			1,000
資金過不足	2,800		900			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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 500		4,000
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入				400		
国債補完供給	▲ 500	400		500		
当預増減	10,800		1,200			6,000
当座預金残高	3,910,100		3,911,300			3,917,300
準備預金残高	3,396,600					
積み終了先	3,396,400					
超過準備	3,396,400				3月6日以降の残り所要積立額 積数	2,100
非準備預金先	513,500				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	99.93%	日数	65.52%		

●2020年3月5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▲0.06~▲0.01%近辺での調達で始まった。昨日に続き調達レートを引き下げる動きが見られ、一巡後は▲0.06~▲0.03%近辺で散発的な出会いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、オフアース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(3/6~3/9)は、▲0.165~▲0.125%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、上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超であった。一部の石油・その他金融業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく穏やか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

2020/3/5	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.101	▲ 0.115	0.030	21,329.12	229.06	107.71-72	107.36-37
T/N	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.150						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.144						
2W							-	▲ 0.144						
3W							-	▲ 0.149						
1M							-	▲ 0.158						
3M							▲ 0.199	▲ 0.161						
6M							▲ 0.220	▲ 0.174						
1Y							▲ 0.250	▲ 0.184						
									日付	2/27	2/28	3/2	3/3	3/4
									日銀当預残	3,999,500	4,018,400	3,978,700	3,964,300	3,899,300
									準備預金残	3,482,400	3,494,800	3,466,400	3,446,500	3,390,100
									マネタリーベース	5,139,900	5,158,900	5,118,900	5,104,900	5,039,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.025%	▲ 0.023%	▲ 0.024%	▲ 0.032%
									コール市場残高	119,208	125,935	138,202	135,465	137,169
									うち無担	98,965	104,106	119,463	117,109	114,514
									うちO/N	68,152	75,283	86,845	73,761	81,616
									うち有担	20,243	21,829	18,739	18,356	22,655

●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)
30年利付国債	65	0.40%	7,000	2020/3/6	2049/12/20	20,709.0	5,674.0	101.6500	0.3390%	29.4762%	101.7500	0.3350%	1,315.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/5	2020/3/6	▲ 0.350	462	462		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/5	2020/3/6	▲ 0.350	54	54		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年3月6日の予定

*1月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲4.0%)	*米国1月の貿易収支	*国庫短期証券(892回)入札 (3ヶ月、47,400億円、3/9発行)
*1月の毎月勤労統計調査速報	*米国1月の卸売売上高	
*1月の景気動向指数速報	*米国1月の消費者信用残高	
*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国2月の雇用統計	

◆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