

# Central Daily Market Report

2020年3月9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9日 需給速報	2020年3月10日 需給予想	2020年3月11日 当社予想
銀行券	900	300	0
財政	4,100	▲ 6,000	▲ 18,000
資金過不足	5,000	▲ 5,700	▲ 18,000
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート
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	3,600	9,600	
CP等買入	4,000	▲ 300	▲ 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	600	100	
国債補完供給	▲ 100	100	100
当預増減	12,900	3,800	▲ 18,000
当座預金残高	3,923,200	3,927,000	3,909,000
準備預金残高	3,412,300		
積み終了先	3,412,100		
超過準備	3,412,100		
非準備預金先	510,900		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,022,500
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数
			79.31%

## ●2020年3月9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▲0.075~▲0.02%近辺での調達で始まった。先週からの流れを引き継ぎ調達レートは徐々に低下し、一巡後は▲0.08~▲0.05%近辺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>

GCT/N(3/10-3/11)は、▲0.160~▲0.080%の出合い。後場は引けにかけて急速にレートを切り上げた。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2Y402~410、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、6M物の入札が実施された。前日3M物のセカンダリーマーケットが▲0.300%台まで買い進まれ、売りが出づらいつつ状況の中、WI取引において▲0.310%で出合う展開となったが、平均落札利回▲0.2872%、按分落札利回▲0.2516%と、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、堅調に推移する中、出合いは見られなかった。この他に、3M物が▲0.345%、1Y物が▲0.295%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は案件少なく、償還総額200億円程度に対して、発行総額は500億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/3/9	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.130	▲ 0.155	▲ 0.015	19,698.76	▲ 1050.99	103.94-96	102.22-25
T/N	▲ 0.075	▲ 0.030	▲ 0.065				-	▲ 0.161						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.002	▲ 0.041				-	▲ 0.161						
2W							-	▲ 0.163						
3W							-	▲ 0.170						
1M							-	▲ 0.182						
3M							▲ 0.345	▲ 0.186						
6M							▲ 0.283	▲ 0.193						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.202						
									日付	3/2	3/3	3/4	3/5	3/6
									日銀当預残	3,978,700	3,964,300	3,899,300	3,910,100	3,910,300
									準備預金残	3,466,400	3,446,500	3,390,100	3,397,400	3,391,000
									マネタリーベース	5,118,900	5,104,900	5,039,800	5,051,000	5,051,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.024%	▲ 0.032%	▲ 0.042%	▲ 0.052%
									コール市場残高	138,202	135,465	137,169	142,386	153,921
									うち無担	119,463	117,109	114,514	120,318	136,600
									うちO/N	86,845	73,761	81,616	85,435	92,392
									うち有担	18,739	18,356	22,655	22,068	17,321

## ●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)
国庫短期証券	893	-	26,000	2020/3/10	2020/9/10	61,081.0	21,155.6	100.1270	▲0.2516%	17.8988%	100.1450	▲0.2872%	4,844.0

## ●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年超3年以下)	4,200	2020/3/10			8,763	4,204	▲0.044		▲0.042	99.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/3/10			11,530	3,401	▲0.051		▲0.050	77.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/3/10			5,415	1,204	▲0.050		▲0.049	91.6
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/3/10			712	301	▲0.140		▲0.113	91.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/9	2020/3/10	▲ 0.350	105	105		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/9	2020/3/10	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年3月10日の予定

*2月のマネーストック	*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値	*5年利付国債入札(19,000億円、3/11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