

# Central Daily Market Report

2020年3月11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11日		2020年3月12日		2020年3月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 800		0	
財政	▲ 18,500		4,500		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 18,300		3,700		▲ 7,000	
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			5,000			
国債買入			4,500			
CP等買入		▲ 400	▲ 500			
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	100		700			
国債補完供給	▲ 300	500	300			
当預増減	▲ 18,400		13,700		▲ 7,000	
当座預金残高	3,904,800		3,918,500		3,911,500	
準備預金残高	3,402,500					
積み終了先	3,402,200				3月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,402,200				積数	
非準備預金先	502,300				1日平均	
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	99.97%	日数	86.21%		

## ●2020年3月11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▲0.085～▲0.03%近辺での調達で始まった。昨日に比べ調達レートは若干低下し、一巡後も同水準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(3/12-3/13)は、▲0.115～▲0.090%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、短国買入オペアが前回と同額の5,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.054%、按分落札利回り較差+0.047%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、3M物が▲0.323～▲0.300%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。CP発行市場はゴム、機械、石油業態で大型発行があった。償還総額3,300億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と償還超となった。発行レートは、引き続き上昇傾向が見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2020/3/11	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	▲ 0.065				-	▲ 0.095	▲ 0.075	▲ 0.025	19,416.06	▲ 451.06	105.01-05	105.01-04
T/N	▲ 0.065	▲ 0.035	▲ 0.062				-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.120						
2W							-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.180						
1M							-	▲ 0.182						
3M							▲ 0.340	▲ 0.199						
6M							▲ 0.255	▲ 0.202						
1Y							▲ 0.260	▲ 0.207						
									日付	3/4	3/5	3/6	3/9	3/10
									日銀当預残	3,899,300	3,910,100	3,910,300	3,923,200	3,923,200
									準備預金残	3,390,100	3,397,400	3,391,000	3,416,100	3,421,500
									マネタリーベース	5,039,800	5,051,000	5,051,200	5,063,300	5,063,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.032%	▲ 0.042%	▲ 0.052%	▲ 0.060%	▲ 0.065%
									コール市場残高	137,169	142,386	153,921	144,141	137,059
									うち無担	114,514	120,318	136,600	126,544	111,041
									うちO/N	81,616	85,435	92,392	83,701	73,308
									うち有担	22,655	22,068	17,321	17,597	26,018

## ●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)
エネルギー対策	-	-	5,000	2020/3/23	2021/3/22	111,100.0	4,999.94		0.0000%	4.5005%		0.0000%	

## ●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	2020/3/12			14,742	5,001	0.047		0.054	96.3
国債買入(残存期間1年以下)	500	2020/3/12			1,259	501	0.006		0.010	83.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/3/12			7,773	3,501	▲ 0.028		▲ 0.017	50.1
国債買入(物価連動債)	300	2020/3/12			1,370	302	▲ 0.360		▲ 0.363	86.1
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2020/3/11	2020/3/12	-0.35	288	288		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2020年3月12日の予定

*1-3月期の法人企業景気予測調査季報	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札(9,000億円、3/13発行)
*2月の企業物価指数	*米国2月の生産者物価指数	

◆本資料は信頼できるとさ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