Central Daily Market Report

2020年3月12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12日 需給速報		2020年3月13日 需給予想		2020年3月16日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 200		0	
財政	5,600		▲ 4,700		2,000	
資金過不足	4,800		▲ 4,900		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						▲ 10,100
国債買現						▲ 6,500
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	4,500					
CP等買入		▲ 500		▲ 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				▲ 100		
ＥＴＦ買入	700		800			
国債補完供給	▲ 900	300		900		
当預増減	13,900		▲ 3,800		▲ 14,600	

当座預金残高	3,918,700	3,914,900	3,900,300
準備預金残高	3,432,100		
積み終了先	3,431,800		
超過準備	3,431,800		
非準備預金先	486,600		

3月13日以降の残り所要積立額	
積数	500
1日平均	200

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	99.98%	日数 89.66%

●2020年3月12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。積み最終日前日であったものの、昨日対比で相場に大きな変化はなく、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>

GC T/N(3/13-3/16)は、▲0.200～▲0.130%の出合い。後場、引け間際にレートを急速に切り下げた。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、低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.250%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は小売、電気機器、石油業態で大型発行があった。償還総額3,000億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と償還超となった。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

2020/3/12	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.066				－	▲ 0.103
T/N	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.059				－	▲ 0.153
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.159
2W			0.005				－	▲ 0.163
3W							－	▲ 0.188
1M							－	▲ 0.196
3M							▲ 0.340	▲ 0.205
6M							▲ 0.250	▲ 0.205
1Y							▲ 0.259	▲ 0.208

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.065	0.010	18,559.63	▲ 856.43	104.52-55	103.66-68

日付	3/5	3/6	3/9	3/10	3/11
日銀当預残	3,910,100	3,910,300	3,923,200	3,923,200	3,904,800
準備預金残	3,397,400	3,391,000	3,416,100	3,421,500	3,403,400
マネタリーベース	5,051,000	5,051,200	5,063,300	5,063,000	5,044,300
無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.052%	▲0.060%	▲0.065%	▲0.065%
コール市場残高	142,386	153,921	144,141	137,059	130,958
うち無担	120,318	136,600	126,544	111,041	106,536
うちO/N	85,435	92,392	83,701	73,308	71,388
うち有担	22,068	17,321	17,597	26,018	24,422

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
20年利付国債	171	0.30%	9,000	2020/3/13	2039/12/20	27,182.0	7,362.0	100.9000	**0.2520%**	**97.2897%**	100.9800	**0.2480%**	1,633.0

●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）		2020/3/12	2020/3/13	▲ 0.350	769	769		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/3/12	2020/3/13	▲ 0.350	90	90		▲0.350	▲0.350	

●2020年3月13日の予定

*1月の第3次産業活動指数　*3月のミシガン大消費者信頼感指数速報　*国庫短期証券（894回）入札（3ヶ月、47,400億円、3/16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。
◆本資料は何ら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論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