

# Central Daily Market Report

2020年3月13日(金)

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13日		2020年3月16日		2020年3月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		400		▲ 1,000	
財政	▲ 4,500		2,500		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 4,700		2,900		▲ 3,000	
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			8,800	▲ 10,100		
国債買現				▲ 7,200		
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			2,100			
CP等買入		▲ 500		▲ 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		▲ 100				
E T F 買入	800		400			
国債補完供給	▲ 2,700	900	2,700			
当預増減	▲ 6,300		▲ 700		▲ 3,000	
当座預金残高	3,912,400		3,911,700		3,908,700	
準備預金残高	3,430,400					
積み終了先	3,430,400					
超過準備	3,430,200					
非準備預金先	482,000					
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,247,700	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2020年3月13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▲0.08~▲0.03%近辺での調達で始まった。実質的な積み最終日となり、一部では取り上がる動きが見られたものの、一巡後は徐々にビッドが減少し、散発的に出合いが見られた程度で今積み期の取引を終えた。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(3/16-3/17)は、▲0.160~▲0.110%の出合い。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。なお、本日は9時30分に国債買現先オペがオファーされた。

### <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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.245~▲0.220%で出合中、平均落札利回▲0.2385%、按分落札利回▲0.1824%と、テールが流れる弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.270~▲0.195%で出合った。この他に、6M物が▲0.270~▲0.230%、1Y物が▲0.240%で出合った。

なお、本日は債券市場の流動性が低下していることなどをを受け、13時に国債買入オペがオファーされた。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、償還は少額で、発行総額は200億円程度と閑散。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

2020/3/13	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.067				-	▲ 0.196	▲ 0.010	0.055	17,431.05	▲ 1,128.58	104.65-69	105.83-85
T/N	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.059				-	▲ 0.198						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.182						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.185						
3W			0.080				-	▲ 0.206						
1M							-	▲ 0.214						
3M							▲ 0.265	▲ 0.219						
6M							▲ 0.250	▲ 0.219						
1Y							▲ 0.259	▲ 0.220						
									日付	3/6	3/9	3/10	3/11	3/12
									日銀当預残	3,910,300	3,923,200	3,923,200	3,904,800	3,918,700
									準備預金残	3,391,000	3,416,100	3,421,500	3,403,400	3,432,300
									マネタリーベース	5,051,200	5,063,300	5,063,000	5,044,300	5,059,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.060%	▲ 0.065%	▲ 0.065%	▲ 0.066%
									コール市場残高	153,921	144,141	137,059	130,958	124,431
									うち無担	136,600	126,544	111,041	106,536	100,660
									うちO/N	92,392	83,701	73,308	71,388	63,162
									うち有担	17,321	17,597	26,018	24,422	23,771

## ●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	894	-	47,400	2020/3/16	2020/6/15	113,460.0	38,562.9	100.0455	▲0.1824%	24.7076%	100.0595	▲0.2385%	8,837.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2020/3/16	2020/3/30		8,840	8,840				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,000	2020/3/16			7,837	2,002	0.025		0.045	14.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/13	2020/3/16	-0.35	2,483	2,483		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/13	2020/3/16	-0.35	116	116		▲0.350	▲0.350	
国債買現先	5,000	2020/3/16	2020/3/30		5	5		▲0.100	▲0.100	

## ●2020年3月16日の予定

*1月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.6%)	*流動性供給入札 (6,000億円、3/17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