

Central Daily Market Report

2020年3月17日(火)

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17日 需給速報	2020年3月18日 需給予想	2020年3月19日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 3,100	▲ 300	12,000
資金過不足	▲ 3,400	▲ 800	11,000
金融調節	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		2,200	
CP等買入			▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)		41,500	▲ 23,700
被災地支援			
社債等買入			▲ 200
E T F買入	600	300	
国債補充供給	▲ 7,500	1,200	7,500
※ドル資金供給用担保確保供給		▲ 11,900	
当預増減	▲ 9,100	14,700	11,000
当座預金残高	3,899,300	3,914,000	3,925,000
準備預金残高	3,411,700		
積み終了先	3,274,000		3月18日以降の残り所要積立額
超過準備	2,845,500		積数 157,400
非準備預金先	487,600		1日平均 5,400
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	95.15%	日数 6.45%

●2020年3月17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▲0.087~▲0.03%とワイドレンジの出合いとなった。積み期序盤という事もあり、取り急ぎ動きは見られず一巡後は落ち着いた地合いとなった。ターム物は引き続きオファーが薄く、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/18-3/19)は、▲0.505~▲0.200%程度での出合い。SCはローラー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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.190~▲0.1825%で出合中、平均落札利回▲0.2021%、按分落札利回▲0.1981%と、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.280~▲0.260%出合いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.330%、6M物が▲0.315~▲0.310%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行となり、陸運業で1,500億円程度の大型発行が見られたのを筆頭に、鉄鋼、機械等の業態でもまとまった額の調達が行われ、発行総額は4,900億円程度と償還総額の3,500億円程度を上回った。発行レートは期内物で足切りが大きく流れる物が見られた一方、昨日の追加緩和を受けてか、一部銘柄では僅かながらレートが低下する動きも見られた。全体的な目線は0%近辺と不変ながら、銘柄ごとに若干差がつく展開となった。

●短期金融市場関連指標

2020/3/17	無担(速報)			有担(速報)			短国 ※買付者統計値	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	▲ 0.068				-	▲ 0.350	0.005	▲ 0.001	17,011.53	9.49	106.22-24	106.86-87
T/N	▲ 0.065	▲ 0.040	▲ 0.045				-	▲ 0.422						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.002	0.001				-	▲ 0.336						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.320						
3W							-	▲ 0.311						
1M							-	▲ 0.301						
3M			0.010				▲ 0.320	▲ 0.281						
6M							▲ 0.310	▲ 0.265						
1Y							▲ 0.255	▲ 0.258						
									日付	3/10	3/11	3/12	3/13	3/16
									日銀当預残	3,923,200	3,904,800	3,918,700	3,912,400	3,908,400
									準備預金残	3,421,500	3,403,400	3,432,300	3,430,400	3,413,300
									マネタリーベース	5,063,000	5,044,300	5,059,100	5,053,000	5,048,800
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.065%	▲0.066%	▲0.067%	▲0.068%
									コール市場残高	137,059	130,958	124,431	128,813	118,326
									うち無担	111,041	106,536	100,660	116,160	98,338
									うちO/N	73,308	71,388	63,162	81,012	67,495
									うち有担	26,018	24,422	23,771	12,653	19,988

●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)	募入最低値	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	895	-	19,000	2020/3/23	2021/3/22	70,937.0	15,419.9	100.1980	▲0.1981%	99.8947%	100.2020	▲0.2021%	3,580.0

●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3年超5年以下)	1,000	2020/3/18			5,381	1,002	0.015		0.018	94.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	1,000	2020/3/18			5,663	1,002	0.018		0.021	19.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/17	2020/3/18	▲ 0.450	6,726	6,726		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/17	2020/3/18	▲ 0.450	582	582		▲ 0.450	▲ 0.450	
米ドル資金供給		2020/3/19	2020/3/26	0.410	2,053	2,053				
米ドル資金供給		2020/3/19	2020/6/11	0.370	30,272	30,272				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5000	2020/3/18	2020/3/27		2,409	2,409		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	10,000	2020/3/18	2020/6/12		9,333	9,333		▲ 0.100	▲ 0.100	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第107回	2020/3/19	2021/3/19	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第46回	2020/3/19	2021/3/19	0

●2020年3月18日の予定

*10-12月期の資金循環統計速報	*米国FOMC(2日目)	*米国FRB経済見通し発表	*国庫短期証券(896回)入札(3ヶ月、47,400億円、3/23発行)
	*米国2月の住宅着工件数	*ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値	

◆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