

Central Daily Market Report

2019年3月11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	2019年3月11日 需給速報	2019年3月12日 需給予想	2019年3月13日 当社予想	
銀行券	700	300	0	
財政	▲ 9,300	5,700	▲ 23,000	
資金過不足	▲ 8,600	6,000	▲ 23,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通	4,800	▲ 4,900		
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入	8,100			
CP等買入		▲ 600	▲ 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				
国債補完供給	▲ 1,000	200	1,000	
当預増減	▲ 2,000	6,700	▲ 23,000	
当座預金残高	3,751,600	3,758,300	3,735,300	
準備預金残高	3,291,200			
積み終了先	3,291,000			
超過準備	3,291,000			
非準備預金先	460,400			
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			2,813,500	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	85.71%

●2019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は、先週末の流れを引き継いで邦銀を中心に▲0.035~▲0.01%の出会い。レポ金利は依然として高く、積みの終盤ということもあり、一巡後は▲0.04~▲0.01%程度で推移した。ターム物に関しては目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/12-3/13)は▲0.035~▲0.01%程度の出合い。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10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61、40Y11などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、レベル感からの買いもあってか3M物で▲0.135~▲0.125%、6M物で▲0.148~▲0.145%の出合いが見られ、引け際に1Y物が▲0.195%が出合うなど、堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は案件少なく、200億円程度の発行と大幅な償還超となった(償還2,000億円程度)。発行レートは引き続き0%近辺であった。

●短期金融市場関連指標

2019/3/11	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.018	▲ 0.040	▲ 0.002	21,125.09	99.53	111.07-09	111.27-29
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.017						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.043						
2W							-	▲ 0.062						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.135	▲ 0.131						
6M							▲ 0.148	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.192	▲ 0.154						
									日付	3/4	3/5	3/6	3/7	3/8
									日銀当預残	3,761,700	3,763,000	3,744,800	3,758,800	3,753,600
									準備預金残	3,300,900	3,312,000	3,296,600	3,305,300	3,314,600
									マネタリーベース	4,881,200	4,882,700	4,864,100	4,878,700	4,873,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.042%	▲ 0.034%	▲ 0.029%	▲ 0.027%
									コール市場残高	107,960	106,116	107,130	107,328	109,933
									うち無担	86,549	84,580	85,650	85,899	88,948
									うちO/N	61,649	59,230	60,970	62,419	61,618
									うち有担	21,411	21,536	21,480	21,429	20,985

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)	106,226	2019/3/11	2019/3/12		927	927		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	31,167	2019/3/11	2019/3/12		1	1		▲0.500	▲0.500	

●2019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	*米国2月の消費者物価指数	*5年利付国債入札(20,000億円、3/13発行)
*1月の特定サービス産業動態統計速報		

◆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