

# Central Daily Market Report

2019年3月13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	2019年3月13日		2019年3月14日		2019年3月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 21,400		2,000		5,000	
資金過不足	▲ 21,000		1,600		4,000	
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			7,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 500	3,500	
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		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	800		100		
当預増減	▲ 15,500		8,700		7,500	
当座預金残高	3,742,100		3,750,800		3,758,300	
準備預金残高	3,291,900					
積み終了先	3,291,700					
超過準備	3,291,700				3月14日以降の残り所要積立額 積数 200	
非準備預金先	450,200				1日平均 100	
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	99.99%	日数	92.86%		

## ●2019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は、邦銀を中心に▲0.03~▲0.002%の出会い。積み終盤による調整の調達からレートは引き続き高止まりが見られた。一巡後は▲0.04~▲0.03%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物については、出会いは閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/14-3/15)は▲0.075~▲0.04%程度 of 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、小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、店頭見合いから3M物で▲0.130%の出会いが見られた。その他には、6M物で▲0.152~▲0.150%での出会いが見られた程度であった。

### <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、15日発行の応当日にあたり鉄鋼、電機、ゴム、食品等の業態から大型案件が見られ、発行量は3,500億円程度まで膨らんだ(償還5,000億円程度)。発行レートは、概ね0%近辺であったが、昨日のCP等買入入への影響から、強めの決着となる銘柄も見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2019/3/13	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.052	▲ 0.050	▲ 0.015	21,290.24	▲ 213.45	111.31-32	111.33-34
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.019				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.126						
1M							-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.135	▲ 0.134						
6M							▲ 0.152	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.189	▲ 0.154						
									日付	3/6	3/7	3/8	3/11	3/12
									日銀当預残	3,744,800	3,758,800	3,753,600	3,751,600	3,757,600
									準備預金残	3,296,600	3,305,300	3,314,600	3,291,200	3,297,200
									マネタリーベース	4,864,100	4,878,700	4,873,700	4,870,900	4,876,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.034%	▲ 0.029%	▲ 0.027%	▲ 0.024%	▲ 0.022%
									コール市場残高	107,130	107,328	109,933	103,293	100,897
									うち無担	85,650	85,899	88,948	82,363	79,280
									うちO/N	60,970	62,419	61,618	55,203	58,120
									うち有担	21,480	21,429	20,985	20,930	21,617

## ●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	案分率	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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/3/14			12,577	4,802	▲0.016		▲0.013	24.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/3/14			5,164	1,814	▲0.013		▲0.012	84.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/3/14			2,211	509	▲0.015		▲0.014	46.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,155	2019/3/13	2019/3/14		52	52		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	3,730	2019/3/13	2019/3/14		5	5		▲0.500	▲0.500	

## ●2019年3月14日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)	*米国1月の新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(820回)入札(3ヶ月、43,400億円、3/18発行)
		*流動性供給入札(6,000億円、3/15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お客様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