

Central Daily Market Report

2019年3月15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	2019年3月15日		2019年3月18日		2019年3月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		400			0
財政	12,200		▲ 900			2,000
資金過不足	12,100		▲ 500			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			1,600	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	3,500	▲ 400				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			37,700	▲ 22,400		
被災地支援社債等買入						
E T F 買入			200			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	15,100		14,100			2,000
当座預金残高	3,765,600		3,779,700			3,781,700
準備預金残高	3,293,600					
積み終了先	3,293,600				3月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,293,500				積数	152,000
非準備預金先	472,000				1日平均	5,200
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						3,096,400
準備預金進捗率	実績	95.09%	日数	6.45%		

●2019年3月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積みの最終日で翌積み期間にかかる取引となったものの、引き続き調達意欲は強くレートは高止まりとなり、邦銀を中心に▲0.03~▲0.01%の出会いとなった。一巡後は▲0.04~▲0.02%で調整の出会いが散見され、本日の取引を終了した。ターム物は、月内のショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(3/18~3/19)は▲0.11~▲0.07%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、小幅低下した。アウトライト市場は、店頭見合いからか3M物で▲0.160~▲0.15%の出合いとなった。この他には、引け際に6M物で▲0.160%、1Y物で▲0.190~▲0.180%での出会いが見られた。

<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、鉄鋼業態等から大型案件が見られ、1,700億円程度の償還に対して、発行は期越え物中心で2,000億円程度であった。発行レートは概ね0%近辺であったが、マイナス圏での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

2019/3/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.070	▲ 0.040	0.005	21,450.85	163.83	111.75-76	111.65-66
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	▲ 0.025	▲ 0.027				-	▲ 0.115						
2W							-	▲ 0.146						
3W							-	▲ 0.138						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.150	▲ 0.136						
6M							▲ 0.160	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.155						
									日付	3/8	3/11	3/12	3/13	3/14
									日銀当預残	3,753,600	3,751,600	3,757,600	3,742,100	3,750,500
									準備預金残	3,314,600	3,291,200	3,297,200	3,291,900	3,303,200
									マネタリーベース	4,873,700	4,870,900	4,876,500	4,860,600	4,869,300
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.024%	▲0.022%	▲0.021%	▲0.023%
									コール市場残高	109,933	103,293	100,897	102,106	101,329
									うち無担	88,948	82,363	79,280	80,684	80,112
									うちO/N	61,618	55,203	58,120	59,534	58,262
									うち有担	20,985	20,930	21,617	21,422	21,217

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/3/18	2019/4/1		1,634	1,634				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	100,904	2019/3/15	2019/3/18		80	80		▲0.500	▲0.500	

●2019年3月18日の予定

*2月の貿易統計

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとし(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する)、買入れ額については、保有残高の増加額年間約80兆円をめどとしつつ、弾力的な買入れを実施する。 (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

◆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