

Central Daily Market Report

2020年3月10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10日		2020年3月11日		2020年3月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		300		0	
財政	▲ 9,200		▲ 19,200		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 9,000		▲ 18,900		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
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	100		100			
国債補完供給	▲ 500	100		500		
当預増減	0		▲ 18,700		▲ 2,000	
当座預金残高	3,923,200		3,904,500		3,902,500	
準備預金残高	3,421,500					
積み終了先	3,421,200		3月11日以降の残り所要積立額		積数 1,100	
超過準備	3,421,200				1日平均 200	
非準備預金先	501,700					
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,022,500	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	82.76%		

●2020年3月10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~▲0.025%近辺での調達で始まった。軟調な展開が続くなか、一巡後はレート水準が若干低下し▲0.08~▲0.05%近辺で散発的な出合いが見られ本日の取引を終えた。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>

GCT/N(3/11-3/12)は、▲0.110~▲0.080%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等にビッドの入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.283%、1Y物が▲0.280%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は石油、医薬品、陸運業態で大型発行があり、償還総額1,500億円程度に対して、発行総額は1,900億円程度と発行超となった。発行レートは、希少銘柄はやや強いビッドが入る一方、発行の多い銘柄ではレートの上昇傾向が見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/3/10	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	▲ 0.065				-	▲ 0.094	▲ 0.050	0.105	19,867.12	168.36	103.08-10	103.84-86
T/N	▲ 0.078	▲ 0.060	▲ 0.075				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.003	0.002				-	▲ 0.117						
2W							-	▲ 0.126						
3W							-	▲ 0.171						
1M							-	▲ 0.176						
3M							▲ 0.342	▲ 0.196						
6M							▲ 0.283	▲ 0.198						
1Y							▲ 0.270	▲ 0.207						
									日付	3/3	3/4	3/5	3/6	3/9
									日銀当預残	3,964,300	3,899,300	3,910,100	3,910,300	3,923,200
									準備預金残	3,446,500	3,390,100	3,397,400	3,391,000	3,416,100
									マネタリーベース	5,104,900	5,039,800	5,051,000	5,051,200	5,063,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.024%	▲ 0.032%	▲ 0.042%	▲ 0.052%	▲ 0.060%
									コール市場残高	135,465	137,169	142,386	153,921	144,141
									うち無担	117,109	114,514	120,318	136,600	126,544
									うちO/N	73,761	81,616	85,435	92,392	83,701
									うち有担	18,356	22,655	22,068	17,321	17,597

●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)
5年利付国債	142	0.10%	19,000	2020/3/11	2024/12/20	43,089.0	15,759.00	101.3700	▲0.1840%	21.4893%	101.5500	▲0.2200%	3,240.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/10	2020/3/11	▲ 0.350	434	434		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/3/12	2020/3/19	1.380	0	0				

●2020年3月11日の予定

*米国2月の財政収支	*エネルギー対策借入
*米国2月の消費者物価指数	(5,000億円、3/23借入)

◆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。

◆本資料は何ら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