

Central Daily Market Report

2020年3月19日(木)
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19日 需給速報 | 2020年3月23日 需給予想 | 2020年3月24日 当社予想 | | | |
|-----------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------|-----------------|-----------|
| 銀行券 | ▲ 1,300 | 500 | 0 | | | |
| 財政 | 18,000 | 88,800 | 5,000 | | | |
| 資金過不足 | 16,700 | 89,300 | 5,000 | | | |
| 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 | | | 1,500 | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国債買入 | 11,900 | | 13,500 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | | ▲ 400 | 5,000 | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 1,600 | | | | |
| E T F買入 | 100 | | 100 | | | |
| 国債補充供給 | ▲ 3,600 | 2,800 | | 3,600 | | |
| 当増減 | 26,000 | | 107,600 | | 10,000 | |
| 当座預金残高 | 3,936,200 | | 4,043,800 | | 4,053,800 | |
| 準備預金残高 | 3,436,600 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,431,400 | | | | 3月23日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,421,500 | | | | 積数 | 23,300 |
| 非準備預金先 | 499,600 | | | | 1日平均 | 1,000 |
| 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 | 99.28% | 日数 | 22.58% | | |

●2020年3月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末の4日積みを迎え邦銀からの調達ニーズが強くレートは上昇した。出合いのレンジは▲0.087~▲0.01%と幅広いものの、出合いの中心は▲0.05%程度となった。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(3/23-3/24)は、▲0.600~▲0.200%程度での出合い。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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、急低下。アウトライト市場は、3M物が▲0.280~▲0.270%、1Y物が▲0.280~▲0.240%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は電気機器、食料品、石油・石炭等の複数業態でまとまった額の調達が行われ、発行総額は3,500億円程度と償還総額の2,300億円程度を上回り、発行超のマーケットとなった。発行レートは昨日に引き続き、期内物や発行残高が積みあがっている銘柄で足切りが大きく流れるなど、全般的に目線が上昇していた。一部ではレート上昇により、当初発行額より減額する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

| 2020/3/19 | 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 | ▲ 0.051 | | | | - | ▲ 0.223 | 0.090 | 0.040 | 16,552.83 | ▲ 173.72 | 108.34-39 | 109.15-17 |
| T/N | ▲ 0.050 | ▲ 0.025 | ▲ 0.040 | | | | - | ▲ 0.268 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.020 | ▲ 0.010 | ▲ 0.011 | | | | - | ▲ 0.239 | | | | | | |
| 2W | | | | | | | - | ▲ 0.269 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.257 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.258 | | | | | | |
| 3M | 0.010 | 0.050 | 0.030 | | | | ▲ 0.278 | ▲ 0.258 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.250 | ▲ 0.255 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.280 | ▲ 0.254 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 3/12 | 3/13 | 3/16 | 3/17 | 3/18 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,918,700 | 3,912,400 | 3,908,400 | 3,899,300 | 3,910,200 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,432,300 | 3,430,400 | 3,413,300 | 3,413,100 | 3,415,900 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 5,059,100 | 5,053,000 | 5,048,800 | 5,040,000 | 5,051,600 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.066% | ▲0.067% | ▲0.068% | ▲0.068% | ▲0.063% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 124,431 | 128,813 | 118,326 | 115,143 | 117,221 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 100,660 | 116,160 | 98,338 | 102,748 | 106,619 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 63,162 | 81,012 | 67,495 | 71,975 | 73,811 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 23,771 | 12,653 | 19,988 | 12,395 | 10,602 |

●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〉 | 20,000 | 2020/3/23 | 2020/3/30 | | 0 | 0 | | | | |
| 共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉 | 20,000 | 2020/3/23 | 2020/4/13 | | 1,500 | 1,500 | | | | |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下) | 2,000 | 2020/3/23 | | | 5,848 | 2,008 | ▲0.005 | | 0.003 | 17.0 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 3,000 | 2020/3/23 | | | 8,935 | 3,006 | 0.000 | | 0.008 | 5.0 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,000 | 2020/3/23 | | | 10,400 | 4,001 | 0.003 | | 0.009 | 93.9 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 3,000 | 2020/3/23 | | | 8,891 | 3,004 | 0.025 | | 0.029 | 91.2 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 1,000 | 2020/3/23 | | | 4,660 | 1,002 | ▲0.005 | | 0.000 | 73.9 |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2020/3/19 | 2020/3/23 | ▲ 0.350 | 2,892 | 2,892 | | ▲0.350 | ▲0.350 | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2020/3/19 | 2020/3/23 | ▲ 0.350 | 629 | 629 | | ▲0.350 | ▲0.350 | |

●2020年3月20日の予定

| |
|--------------|
| *春分の日 |
| *米国2月の中古住宅販売 |

●2020年3月23日の予定

| |
|-----------|
| *特にありません。 |
|-----------|

◆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