

# Central Daily Market Report

2019年2月1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2月1日		2019年2月4日		2019年2月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		1,100		1,000	
財政	▲ 28,100		▲ 80,100		5,000	
資金過不足	▲ 27,700		▲ 79,000		6,000	
<b>金融調節</b>	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			700	▲ 1,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
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		200				
当預増減	▲ 27,600		▲ 80,100		6,000	
当座預金残高	3,859,600		3,779,500		3,785,500	
準備預金残高	3,380,900					
積み終了先	3,380,700		2月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,380,400		積数		2,000	
非準備預金先	478,700		1日平均		200	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,134,800	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	61.29%		

## ●2019年2月1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▲0.086~▲0.03%の出会いとレンジは変わらないものの、月末要因剥落により調達サイドが増加した印象。出会い一巡後は目立った取引が見られなかった。ターム物に関しても目立った出合いは見られなかった。固定金利方式による共通担保資金共通オペは2W物が8,000億円オフアされた。結果は706億円(期落ち分1,706億円)で未達となった。

### <レポ市場>

GC T+0(2/1-2/4)は▲0.10~▲0.08%程度、T/N(2/4-2/5)は▲0.10~▲0.085%程度の出合いだった。前日に続いて調達サイドがしっかりしており、レートは小幅に上昇した。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10Y337、341、342や、5Y126、127、129、130、131などにビッドが目立った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.220%から一時▲0.290%まで買い進まれ、最終的に▲0.270%出合いで引ける展開となる中、平均落札利回▲0.2653%、按分落札利回▲0.2307%と前回債からレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物が▲0.274~▲0.265%での出合いと堅調に推移した。この他に、1Y物が▲0.210~▲0.190%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は鉄鋼・卸売・その他金融業態で大型の発行があり、償還総額1,700億円程度に対して、発行総額は3,500億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは0%付近での決着が中心で、変動はなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/2/1	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N		▲ 0.086	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.094	▲ 0.025	▲ 0.024	20,788.39	14.90	108.85-86	108.93-95
T/N				▲ 0.020				-	▲ 0.095						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.022	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.101						
2W				▲ 0.043				-	▲ 0.106						
3W				0.000				-	▲ 0.118						
1M		▲ 0.013	0.200	▲ 0.003				-	▲ 0.132						
3M								▲ 0.270	▲ 0.166						
6M								▲ 0.200	▲ 0.161						
1Y								▲ 0.210	▲ 0.161						

日付	1/25	1/28	1/29	1/30	1/31
日銀当預残	3,866,500	3,876,700	3,884,200	3,883,400	3,887,200
準備預金残	3,365,900	3,377,600	3,386,700	3,382,200	3,385,100
マネタリーベース	4,983,600	4,993,200	5,000,700	4,999,200	5,003,200
無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.064%	▲ 0.063%	▲ 0.060%
コール市場残高	96,641	102,011	95,965	99,756	98,184
うち無担	80,872	77,083	77,778	78,609	65,010
うちO/N	47,592	44,413	45,718	46,349	35,115
うち有担	15,769	24,928	18,187	21,147	33,174

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
国庫短期証券	811	-	43,400	2019/2/4	2019/5/13	126,680.5	35,114.7	100.0620	▲ 0.2307%	6.2558%	100.0713	▲ 0.2653%	8,285.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/2/13	2019/8/14	244,778.0	10,500.23		0.0000%	4.3108%		0.0000%	

## ●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>	8,000	2019/2/4	2019/2/18		706	706				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	23,745	2019/2/1	2019/2/4		4	4		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)	10,000	2019/2/1	2019/2/4		1	1		▲ 0.600	▲ 0.600	

## ●2019年2月4日の予定

*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支	*米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫
*1月のマネタリーベース	*米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫(延期)

◆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