

Central Daily Market Report

2019年2月4日(月)

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4日		2019年2月5日		2019年2月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,000		600		1,000	
財政	▲ 76,200		▲ 300		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 75,200		300		▲ 22,000	
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	700	▲ 1,700				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,600			
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			200		
当預増減	▲ 76,500		11,000		▲ 22,000	
当座預金残高	3,783,100		3,794,100		3,772,100	
準備預金残高	3,305,500					
積み終了先	3,305,400					
超過準備	3,305,400					
非準備預金先	477,600					
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	64.52%		

●2019年2月4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▲0.080～▲0.025%の出会いが中心となった。税揚げによる大幅な不足日に当たり、出会い一巡後もビッドが残る展開となった。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T+0(2/4-2/5)は▲0.095～▲0.085%程度、T/N(2/5-2/6)は▲0.10～▲0.090%程度の出合い。利国の買入オベが入ったものの、売物はしっかりとの展開であった。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、5Y130、137、138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。アウトライ市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.270%、1Y物が▲0.210%で出合った。

＜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、案件が少ない中、電気機器、ノンバンク業態から大型案件が見られ発行総額は800億円程度であった(償還総額300億円程度)。発行レートは概ね0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2019/2/4	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.093	▲ 0.015	0.010	20,883.77	95.38	109.44-45	109.83-85		
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.096								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.099								
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.031				-	▲ 0.107								
3W							-	▲ 0.119								
1M							-	▲ 0.132								
3M							▲ 0.270	▲ 0.165								
6M							▲ 0.200	▲ 0.161								
1Y							▲ 0.210	▲ 0.161								
											日付	1/28	1/29	1/30	1/31	2/1
											日銀当預残	3,876,700	3,884,200	3,883,400	3,887,200	3,859,600
											準備預金残	3,377,600	3,386,700	3,382,200	3,385,100	3,381,500
											マネタリーベース	4,993,200	5,000,700	4,999,200	5,003,200	4,975,200
											無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.060%	▲0.061%
											コール市場残高	102,011	95,965	99,756	98,184	116,392
											うち無担	77,083	77,778	78,609	65,010	86,392
											うちO/N	44,413	45,718	46,349	35,115	56,157
											うち有担	24,928	18,187	21,147	33,174	30,000

●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	申込総額(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1年超3年以下)	3,500	2019/2/5			9,093	3,508	0.005		0.005	99.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/2/5			11,930	4,005	0.007		0.007	52.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/2/5			6,567	2,009	0.006		0.007	54.8
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/2/5			1,626	504	0.006		0.007	40.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	95,428	2019/2/4	2019/2/5		19	19		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,511	2019/2/4	2019/2/5		118	118		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月5日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国12月の貿易収支(延期) *米国1月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札 (22,000億円、2/6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