

Central Daily Market Report

2019年2月5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	2019年2月5日		2019年2月6日		2019年2月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		600		0	
財政	▲ 1,400		▲ 27,300		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 800		▲ 26,700		▲ 4,000	
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			2,500			
国債買入	10,600					
CP等買入		▲ 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	▲ 100	200		100		
当預増減	9,800		▲ 24,100		▲ 4,000	
当座預金残高	3,792,900		3,768,800		3,764,800	
準備預金残高	3,320,300					
積み終了先	3,320,200		2月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,320,200		積数		1,700	
非準備預金先	472,600		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	99.95%	日数	67.74%		

●2019年2月5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▲0.075~▲0.025%の出会いが中心となった。昨日に続き資金調達サイドが堅調で、一部には取り上がる動きも見られた。一巡後はビッド残りになる中、▲0.025%で調整の出会いが見られた程度であった。ターム物に関してはオファーが出難く、出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(2/5-2/6)は▲0.090~▲0.085%程度、T/N(2/6-2/7)は▲0.100~▲0.080%程度の出合い。T/Nは売物がしかりの展開であった。SCはローラー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、小幅上昇。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が約1.1兆円と依然多く、平均落札利回較差+0.036%、按分落札利回較差+0.015%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、引け際に3M物が▲0.270%で、1Y物が▲0.205~▲0.200%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、償還総額1,300億円程度に対して発行総額が900億円程度と償還超であった。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2019/2/5	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)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.093	▲ 0.015	0.000	20,844.45	▲ 39.32	109.98-99	109.85-87
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.098						
2W							-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.119						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.270	▲ 0.166						
6M							▲ 0.200	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.161						
									日付	1/29	1/30	1/31	2/1	2/4
									日銀当預残	3,884,200	3,883,400	3,887,200	3,859,600	3,783,100
									準備預金残	3,386,700	3,382,200	3,385,100	3,381,500	3,306,700
									マネタリーベース	5,000,700	4,999,200	5,003,200	4,975,200	4,897,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.063%	▲ 0.060%	▲ 0.061%	▲ 0.061%
									コール市場残高	95,965	99,756	98,184	116,392	107,352
									うち無担	77,778	78,609	65,010	86,392	79,185
									うちO/N	45,718	46,349	35,115	56,157	46,350
									うち有担	18,187	21,147	33,174	30,000	28,167

●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)
10年利付国債	353	0.10%	22,000	2019/2/6	2028/12/20	84,940.0	17,702.00	101.1100	▲0.0120%	61.9168%	101.1200	▲0.0130%	4,285.0

●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
国庫短期証券買入	2,500	2019/2/6			11,167	2,502	0.015		0.036	45.6
CP等買入	2,000	2019/2/8			7,230	1,980	▲0.001		▲0.001	40.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,134	2019/2/5	2019/2/6		77	77		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/2/5	2019/2/6		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/2/7	2019/2/14	2.9	6	6				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2019/2/6	2019/2/15		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2019年2月6日の予定

*米国11月の貿易収支

*交付税特別会計借入
(10,500億円、2/19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