

# Central Daily Market Report

2019年2月6日(水)

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6日		2019年2月7日		2019年2月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲ 500	▲ 500	▲ 500	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	▲ 27,400	3,200	3,200	3,200	▲ 10,000	▲ 10,000
資金過不足	▲ 26,800	2,700	2,700	2,700	▲ 11,000	▲ 11,000
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			5,300			
CP等買入					2,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 24,200	8,000	8,000	8,000	▲ 9,000	▲ 9,000
当座預金残高	3,768,700	3,776,700	3,776,700	3,776,700	3,767,700	3,767,700
準備預金残高	3,302,400					
積み終了先	3,302,200					
超過準備	3,302,200				2月7日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	466,300				積数	1,500
					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	70.97%		

## ●2019年2月6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。引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは堅調で、一部には取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.070%程度で調整の出会いが見られていた。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(2/6-2/7)は▲0.085~▲0.075%程度、T/N(2/7-2/8)は▲0.085~▲0.075%程度の出合い。T/Nは売物がしつかりの展開であった。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。アウトライト市場は、6M物と3M物の2回の入札を控え動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.262~▲0.260%で、1Y物が▲0.205%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900億円程度に対して発行総額1,000億円程度であった。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

2019/2/6	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.079	▲ 0.020	▲ 0.005	20,874.06	29.61	109.94-95	109.66-67
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.037	▲ 0.015	▲ 0.028				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.037	▲ 0.012	▲ 0.021				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.116						
1M			0.000				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.262	▲ 0.162						
6M							▲ 0.200	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.161						
									日付	1/30	1/31	2/1	2/4	2/5
									日銀当預残	3,883,400	3,887,200	3,859,600	3,783,100	3,792,900
									準備預金残	3,382,200	3,385,100	3,381,500	3,306,700	3,320,600
									マネタリーベース	4,999,200	5,003,200	4,975,200	4,897,700	4,906,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.060%	▲ 0.061%	▲ 0.061%	▲ 0.058%
									コール市場残高	99,756	98,184	116,392	107,352	116,847
									うち無担	78,609	65,010	86,392	79,185	92,672
									うちO/N	46,349	35,115	56,157	46,350	60,987
									うち有担	21,147	33,174	30,000	28,167	24,175

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/2/19	2019/8/22	267,309.0	10,500.07		0.0000%	3.9281%		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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/2/7			2,282	500		0.040	0.040	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/2/7			8,599	4,309	▲0.005		▲0.004	51.7
国債買入(物価連動債)	250	2019/2/7			1,181	250		0.050	▲0.005	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,440	2019/2/6	2019/2/7		24	24		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年2月7日の予定

*12月の景気動向指数速報	*米国12月の消費者信用残高	*国庫短期証券(812回)入札
*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*英中銀MPC結果発表	(6ヶ月、23,000億円、2/12発行)
		*30年利付国債入札
		(7,000億円、2/8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