

# Central Daily Market Report

2019年2月7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	2019年2月7日		2019年2月8日		2019年2月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 100		1,000	
財政	3,700		▲ 9,700		▲ 6,000	
資金過不足	3,100		▲ 9,800		▲ 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						▲ 7,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,300					
CP等買入			2,000	▲ 200		
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			500			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	8,300		▲ 7,400		▲ 12,000	
当座預金残高	3,777,000		3,769,600		3,757,600	
準備預金残高	3,314,900					
積み終了先	3,314,700				2月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,314,700				積数	1,300
非準備預金先	462,100				1日平均	200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						3,135,900
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

## ●2019年2月7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▲0.070~▲0.025%の出合いが中心となった。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%程度で調整の出合いが見られていた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T+0(2/7-2/8)は▲0.085~▲0.075%程度、T/N(2/8-2/12)は▲0.090~▲0.080%程度の出合い。足元は売物がしかりの展開。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。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.205%から一時▲0.240%まで買い進まれ、最終的に▲0.230%出合いで引ける展開となったものの、平均落札利回り▲0.2043%、按分落札利回り▲0.1943%と落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.210~▲0.193%での出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、3M物が▲0.250%、1Y物が▲0.195~▲0.190%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、鉄鋼、ノンバンク業態から大型案件が見られ、発行総額は1,700億円程度であった(償還総額1,600億円程度)。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

2019/2/7	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	▲ 0.051				-	▲ 0.082	▲ 0.015	0.005	20,751.28	▲ 122.78	109.99-01	109.91-93
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.091						
2W							-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.121						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.133						
3M							▲ 0.250	▲ 0.161						
6M							▲ 0.195	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.161						
									日付	1/31	2/1	2/4	2/5	2/6
									日銀当預残	3,887,200	3,859,600	3,783,100	3,792,900	3,768,700
									準備預金残	3,385,100	3,381,500	3,306,700	3,320,600	3,302,700
									マナタリベース	5,003,200	4,975,200	4,897,700	4,906,900	4,882,200
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.061%	▲0.061%	▲0.058%	▲0.052%
									コール市場残高	98,184	116,392	107,352	116,847	122,397
									うち無担	65,010	86,392	79,185	92,672	92,872
									うちO/N	35,115	56,157	46,350	60,987	61,217
									うち有担	33,174	30,000	28,167	24,175	29,525

## ●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)
国庫短期証券	812	-	23,000	2019/2/12	2019/8/13	86,641.0	18,610.4	100.0970	▲0.1943%	78.7723%	100.1020	▲0.2043%	4,389.0
30年利付国債	61	0.70%	7,000	2019/2/8	2048/12/20	26,589.0	5,634.0	102.8000	0.5890%	63.1931%	102.8500	0.5870%	1,357.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,788	2019/2/7	2019/2/8		131	131		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年2月8日の予定

- \*12月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+0.8%)
- \*12月の国際収支
- \*12月の毎月勤労統計調査速報
- \*12月の特定サービス産業動態統計速報
- \*1月の景気ウォッチャー調査
- \*米国12月の卸売売上高(延期)
- \*国庫短期証券(813回)入札 (3ヶ月、43,400億円、2/12発行)
- \*エネルギー対策借入 (5,000億円、2/20借入)

◆本資料は信頼できるとさ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