

Central Daily Market Report

2019年2月8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8日		2019年2月12日		2019年2月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		500		1,000	
財政	▲ 10,000		▲ 1,500		5,000	
資金過不足	▲ 10,000		▲ 1,000		6,000	
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			3,300	▲ 7,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,100			
CP等買入	2,000	▲ 200		▲ 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		200			
国債補充供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 7,700		7,500		6,000	
当座預金残高	3,769,300		3,776,800		3,782,800	
準備預金残高	3,323,200					
積み終了先	3,323,000		2月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,323,000		積数		500	
非準備預金先	446,100		1日平均		100	
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	99.98%	日数	87.10%		

●2019年2月8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▲0.065~▲0.020%の出合いが中心となった。週末4日積みとなることから、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▲0.065~▲0.025%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(2/8-2/12)は▲0.09~▲0.08%程度、T/N(2/12-2/13)は▲0.095~▲0.080%程度の出合い。足元は売物がしつかりの展開。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10Y334、10Y337、341、342や、5Y130、137、138などにビッドが目立った。

<短国市場>

アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.210~▲0.205%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.2158%、按分落札利回▲0.2012%と前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物が▲0.210%から▲0.230%まで買い進まれるなど、全般的に強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.205~▲0.195%で、1Y物が▲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。発行市場は償還が800億円程度あったが、発行案件少なく極めて閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2019/2/8	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	▲ 0.047				-	▲ 0.085	▲ 0.031	▲ 0.016	20,333.17	▲ 418.11	109.76-77	109.74-75
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.016				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.124						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.225	▲ 0.163						
6M							▲ 0.204	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.163						
									日付	2/1	2/4	2/5	2/6	2/7
									日銀当預残	3,859,600	3,783,100	3,792,900	3,768,700	3,777,000
									準備預金残	3,381,500	3,306,700	3,320,600	3,302,700	3,314,900
									マネタリーベース	4,975,200	4,897,700	4,906,900	4,882,200	4,891,000
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.061%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.049%
									コール市場残高	116,392	107,352	116,847	122,397	111,261
									うち無担	86,392	79,185	92,672	92,872	86,758
									うちO/N	56,157	46,350	60,987	61,217	55,503
									うち有担	30,000	28,167	24,175	29,525	24,503

●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)	募入最低値	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	813	-	43,400	2019/2/12	2019/5/20	138,552.0	35,110.5	100.0535	▲0.2012%	17.9714%	100.0574	▲0.2158%	8,289.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2019/2/20	2020/2/20	91,022.0	5,000.00		0.0000%	5.4932%		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	2019/2/12	2019/2/25		3,325	3,325				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/2/12			9,572	3,505	▲0.008		▲0.007	73.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/2/12			5,267	4,002	▲0.014		▲0.010	1.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/2/12			10,746	4,314	▲0.017		▲0.015	17.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	28,654	2019/2/8	2019/2/12		81	81		▲0.500	▲0.500	

●2019年2月11日の予定

*建国記念の日	*英国10-12月期のGDP速報値
---------	-------------------

●2019年2月12日の予定

*12月の第3次産業活動指数	*米国1月の財政収支(延期)
*1月のマネーストック	

◆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