

# Central Daily Market Report

2019年2月12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12日		2019年2月13日		2019年2月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		1,000		0	
財政	3,400		▲1,200		▲27,000	
資金過不足	3,800		▲200		▲27,000	
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		2,500			
CP等買入		▲200		▲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	200		200			
国債補完供給		100				
当預増減	12,300		2,400		▲27,000	
当座預金残高	3,781,600		3,784,000		3,757,000	
準備預金残高	3,332,400					
積み終了先	3,332,200		2月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,332,200		積数		400	
非準備預金先	449,200		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	99.99%	日数	90.32%		

## ●2019年2月12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%の出合いが中心となった。▲0.065%で寄り付いた後は、先週末の流れを引き継いで▲0.070~▲0.020%の出合いが中心となった。一巡後は調整から▲0.080%の出合いが見られるなど、先週末対比でみると、取り上がる動きは限定的であった。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T+0(2/12-2/13)は▲0.085~▲0.080%程度、T/N(2/13-2/14)は▲0.090~▲0.070%程度の出合い。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10Y334~353、5Y130~138などにビッドの出入りが目立った。

### <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、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.240~▲0.230%、6M物が▲0.209%、1Y物が▲0.210%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは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、発行総額は1,200億円程度と若干の発行超であった。一部の小売業態において大型案件が見られたものの、案件数はあまり膨らまず落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/2/12	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	▲0.049				-	▲0.088	▲0.015	0.016	20,864.21	531.04	110.39-40	110.61-63
T/N			▲0.020				-	▲0.090						
S/N							-	-						
1W			▲0.005				-	▲0.105						
2W	▲0.005	0.000	▲0.001				-	▲0.115						
3W							-	▲0.126						
1M			▲0.040				-	▲0.140						
3M							▲0.230	▲0.163						
6M							▲0.204	▲0.163						
1Y							▲0.209	▲0.163						
									日付	2/4	2/5	2/6	2/7	2/8
									日銀当預残	3,783,100	3,792,900	3,768,700	3,777,000	3,769,300
									準備預金残	3,306,700	3,320,600	3,302,700	3,314,900	3,323,600
									マネタリーベース	4,897,700	4,906,900	4,882,200	4,891,000	4,883,300
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.049%	▲0.047%
									コール市場残高	107,352	116,847	122,397	111,261	123,083
									うち無担	79,185	92,672	92,872	86,758	95,838
									うちO/N	46,350	60,987	61,217	55,503	58,183
									うち有担	28,167	24,175	29,525	24,503	27,245

## ●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	応募総額(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10年超25年以下)	1,800	2019/2/13			7,119	1,806	0.014		0.015	45.8
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/2/13			1,816	504	0.014		0.016	26.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	39,713	2019/2/12	2019/2/13		37	37		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2019/2/14	2019/2/22	2.9	3	3				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2019/2/13	2019/2/25		2	2		▲0.100	▲0.100	

## ●2019年2月13日の予定

*1月の企業物価指数	*米国1月の消費者物価指数	*5年利付国債入札(20,000億円、2/14発行)
	*米国12月の財政収支	
	*英国1月の消費者物価指数	

◆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