

Central Daily Market Report

2019年2月13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13日		2019年2月14日		2019年2月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		▲ 700			0
財政	▲ 1,800		▲ 31,600			84,000
資金過不足	▲ 900		▲ 32,300			84,000
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			5,000			
国債買入	2,500					
CP等買入		▲ 100		▲ 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				▲ 100		
E T F買入	200					
国債補完供給	▲ 300			300		
当預増減	1,400		▲ 27,300			84,000
当座預金残高	3,783,000		3,755,700			3,839,700
準備預金残高	3,337,600					
積み終了先	3,337,400				2月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,337,400				積数	300
非準備預金先	445,400				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	93.55%		

●2019年2月13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~▲0.020%の出会いが中心となった。一巡後は▲0.086~▲0.075%で調整の出会いも見られたが、概ね横ばい圏で推移した。また一部で地銀業態の試し取りの出会いが見られた。ターム物に関してはショートタームで▲0.025%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(2/13-2/14)は▲0.090~▲0.085%程度、T/N(2/14-2/15)は▲0.090~▲0.075%程度の出会い。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、小幅上昇。アウトライト市場では、短国買入オベが5,000億円(前回比+2,500億円)でオファーされた。応札額が2兆円台と依然多く、平均落札利回較差+0.025%、按分落札利回較差+0.021%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、6M物が▲0.196~▲0.188%、1Y物が▲0.192~▲0.185%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。CP発行市場は償還総額4,500億円程度に対して、発行総額は4,000億円程度と償還超であった。5・10日発行となり複数業態において大型案件が見られ比較的活況な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。本日はCP等買入オベが2,000億円オファーされた。入札結果は平均落札・按分レート共に▲0.001%と、前回(平均落札・按分レート共に▲0.001%)比で横ばいの結果となった。

●短期金融市場関連指標

2019/2/13	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				-	▲ 0.087	▲ 0.010	0.005	21,144.48	280.27	110.51-52	110.68-69
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.037	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.112						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.122						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.230	▲ 0.164						
6M							▲ 0.196	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.192	▲ 0.164						
									日付	2/5	2/6	2/7	2/8	2/12
									日銀当預残	3,792,900	3,768,700	3,777,000	3,769,300	3,781,600
									準備預金残	3,320,600	3,302,700	3,314,900	3,323,600	3,331,100
									マネタリーベース	4,906,900	4,882,200	4,891,000	4,883,300	4,895,200
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.052%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.049%
									コール市場残高	116,847	122,397	111,261	123,083	105,565
									うち無担	92,672	92,872	86,758	95,838	78,572
									うちO/N	60,987	61,217	55,503	58,183	48,747
									うち有担	24,175	29,525	24,503	27,245	26,993

●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)
5年利付国債	138	0.10%	20,000	2019/2/14	2023/12/20	78,587.0	16,230.00	101.2200	▲0.1490%	15.4016%	101.2300	▲0.1510%	3,764.0

●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	5,000	2019/2/14			21,174	5,000	0.021		0.025	82.9
CP等買入	2,000	2019/2/18			5,960	1,970	▲0.001		▲0.001	55.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2019/2/13	2019/2/14		256	256		▲0.500	▲0.500	

●2019年2月14日の予定

*10-12月期のGDP1次速報

*米国11月の企業在庫
*米国12月の小売売上高
*米国1月の生産者物価指数
*ユーロ圏10-12月期のGDP2次速報

◆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。

◆本資料は何ら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お客様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