

Central Daily Market Report

2019年2月15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15日		2019年2月18日		2019年2月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		600		0	
財政	84,700		▲ 9,000		▲ 1,000	
資金過不足	84,900		▲ 8,400		▲ 1,000	
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			700	▲ 700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,900					
CP等買入		▲ 500	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	▲ 200	100		200		
当預増減	90,700		▲ 6,400		▲ 1,000	
当座預金残高	3,847,100		3,840,700		3,839,700	
準備預金残高	3,360,300					
積み終了先	3,360,300				2月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,360,200				積数 94,400	
非準備預金先	486,800				1日平均 3,600	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,820,500	
準備預金進捗率	実績	96.65%	日数	7.14%		

●2019年2月15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▲0.086~▲0.025%の出合いが中心となった。年金定時払い日、翌積み期間にかかる取引となり、一部調達に慎重姿勢も見られ、前日比で小幅に低下して推移した。積み最終日のため、一巡後は目途が付いた先も多く、特段の出合いは見られなかった。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。固定金利方式による共通担保資金共通オペは2W物が8,000億円オファーされた。結果は708億円の応札(期落ち額706億円)で未達となった。

<レポ市場>

GC T+0(2/15-2/18)は▲0.110~▲0.105%程度、T/N(2/18-2/19)は▲0.120~▲0.105%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▲0.205%から▲0.22%まで買い進まれる展開となった。償還日が海外市場の祝日と重なったことでレート上昇も予想されたものの、平均落札利回▲0.2106%、按分落札利回▲0.1954%と、WI取引を反映し、堅調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.205~▲0.200%と按分レート近辺での出合いが見られた。この他に、6M物が▲0.205~▲0.199%で、1Y物が▲0.194~▲0.188%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100億円程度に対して、発行総額は500億円程度と若干の発行超であった。案件数は少なく小型発行を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートはショートターム物やノンバンク銘柄において上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/2/15	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.057				-	▲ 0.103	▲ 0.025	▲ 0.010	20,900.63	▲ 239.08	110.53-55	110.31-33
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.025				-	▲ 0.127						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.036				-	▲ 0.134						
3W							-	▲ 0.137						
1M	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.032				-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.204	▲ 0.164						
6M							▲ 0.205	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.194	▲ 0.164						
									日付	2/7	2/8	2/12	2/13	2/14
									日銀当預残	3,777,000	3,769,300	3,781,600	3,783,000	3,756,400
									準備預金残	3,314,900	3,323,600	3,331,100	3,338,800	3,326,600
									マネタリーベース	4,891,000	4,883,300	4,895,200	4,895,600	4,869,700
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.047%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.052%
									コール市場残高	111,261	123,083	105,565	116,646	110,259
									うち無担	86,758	95,838	78,572	86,108	78,820
									うちO/N	55,503	58,183	48,747	56,773	51,985
									うち有担	24,503	27,245	26,993	30,538	31,439

●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	814	-	43,400	2019/2/18	2019/5/27	140,643.5	35,208.5	100.0525	▲0.1954%	22.7638%	100.0566	▲0.2106%	8,191.0
物価連動10年	23	0.10%	4,000	2019/2/18	2028/3/10	13,361.0	3,996.0	103.6000	▲0.2870%	16.3120%			
国有林野借入	-	-	963	2019/2/25	2024/5/25	3,440.0	963.00		0.0000%	100.0000%		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	2019/2/18	2019/3/4		708	708				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,026	2019/2/15	2019/2/18		234	234		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月18日の予定

*12月の機械受注統計	*New York祝日(Presidents' Day)
-------------	-------------------------------

◆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