

Central Daily Market Report

2019年2月18日(月)
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18日		2019年2月19日		2019年2月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500	▲ 100	▲ 1,000			
財政	▲ 8,100	5,100	▲ 20,000			
資金過不足	▲ 7,600	5,000	▲ 21,000			
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			10,100			
CP等買入	2,000	▲ 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						
国債補完供給	▲ 100	200	100			
当預増減	▲ 5,700	15,100	▲ 21,000			
当座預金残高	3,841,400	3,856,500	3,835,500			
準備預金残高	3,351,700					
積み終了先	3,326,300					
超過準備	3,303,700			2月19日以降の残り所要積立額		
非準備預金先	489,700			積数	46,400	
				1日平均	1,900	
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	98.35%	日数	10.71%		

●2019年2月18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~▲0.030%の出会いが中心となった。新積み期に入ったことから資金調達サイドの慎重姿勢が強まり、レートは低下しての推移となった。一巡後は▲0.080%で調整の出会いが見られたほか、地銀業態の試し取りの出会いも散見された。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(2/18-2/19)は▲0.105~▲0.090%程度、T/N(2/19-2/20)は▲0.115~▲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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.21~▲0.205%、6M物が▲0.210%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、鉄鋼・小売業態で大型案件が見られ、償還総額2,000億円程度に対して、発行総額は3,100億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/2/18	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	▲ 0.063				-	▲ 0.101	▲ 0.025	0.000	21,281.85	381.22	110.56-57	110.54-56
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.117						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.031				-	▲ 0.128						
3W							-	▲ 0.131						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.207	▲ 0.164						
6M							▲ 0.210	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.194	▲ 0.164						
									日付	2/8	2/12	2/13	2/14	2/15
									日銀当預残	3,769,300	3,781,600	3,783,000	3,756,400	3,847,100
									準備預金残	3,323,600	3,331,100	3,338,800	3,326,600	3,359,100
									マネタリーベース	4,883,300	4,895,200	4,895,600	4,869,700	4,960,300
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.049%	▲0.051%	▲0.052%	▲0.057%
									コール市場残高	123,083	105,565	116,646	110,259	91,875
									うち無担	95,838	78,572	86,108	78,820	73,092
									うちO/N	58,183	48,747	56,773	51,985	50,427
									うち有担	27,245	26,993	30,538	31,439	18,783

●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	業分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/2/19			9,632	3,508	▲0.004		▲0.003	17.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/2/19			11,705	4,007	▲0.008		▲0.007	94.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/2/19			4,708	1,808	0.002		0.002	94.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/2/19			2,374	504	▲0.001		▲0.001	95.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	42,719	2019/2/18	2019/2/19		43	43		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2019/2/18	2019/2/19		9	9		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月19日の予定

*国庫短期証券(815回)入札 (1年、19,000億円、2/20発行)
*20年利付国債入札 (10,000億円、2/20発行)

◆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