

Central Daily Market Report

2019年2月19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19日 需給速報	2019年2月20日 需給予想	2019年2月21日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 600	▲ 1,000			
財政	2,200	▲ 20,300	1,000			
資金過不足	2,100	▲ 20,900	0			
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						
国債買入	10,100					
CP等買入		▲ 100	▲ 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				
当預増減	12,200	▲ 21,000				0
当座預金残高	3,853,600	3,832,600	3,832,600			
準備預金残高	3,362,400					
積み終了先	3,350,600			2月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,342,000			積数	25,900	
非準備預金先	491,200			1日平均	1,100	
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	99.08%	日数	14.29%		

●2019年2月19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▲0.085～▲0.030%の出会いが中心となるなど、地銀業態を中心に調達ニーズは底堅かった。一巡後も▲0.080～▲0.065%の出会いが散見された。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(2/19-2/20)は▲0.105～▲0.090%程度、T/N(2/20-2/21)は▲0.115～▲0.105%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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.192～▲0.189%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1906%、按分落札利回▲0.1886%とWI取引を反映し、前回債からレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.205～▲0.200%出会いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.209%、6M物が▲0.217～▲0.215%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、償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,300億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

2019/2/19	無担(速報)			有担(速報)			短期 先買参考統計値	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				-	▲ 0.106	▲ 0.035	▲ 0.010	21,302.65	20.80	110.59-60	110.66-67
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.115						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.230	▲ 0.020				-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.034				-	▲ 0.128						
3W			0.000				-	▲ 0.131						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.142						
3M							▲ 0.209	▲ 0.163						
6M							▲ 0.218	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.204	▲ 0.164						
									日付	2/12	2/13	2/14	2/15	2/18
									日銀当預残	3,781,600	3,783,000	3,756,400	3,847,100	3,841,400
									準備預金残	3,331,100	3,338,800	3,326,600	3,359,100	3,351,800
									マネタリーベース	4,895,200	4,895,600	4,869,700	4,960,300	4,954,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.049%	▲ 0.051%	▲ 0.052%	▲ 0.057%	▲ 0.063%
									コール市場残高	105,565	116,646	110,259	91,875	103,747
									うち無担	78,572	86,108	78,820	73,092	80,256
									うちO/N	48,747	56,773	51,985	50,427	53,741
									うち有担	26,993	30,538	31,439	18,783	23,491

●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	815	-	19,000	2019/2/20	2020/2/20	83,522.0	15,417.5	100.1890	▲0.1886%	24.3455%	100.1910	▲0.1906%	3,582.0
20年利付国債	167	0.50%	10,000	2019/2/20	2038/12/20	37,311.0	7,996.0	101.4000	0.4230%	29.3637%	101.4700	0.4190%	1,991.0

●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
社債等買入	500	2019/2/25			1,647	500	0.050		0.062	25.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2019/2/19	2019/2/20		33	33		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/2/19	2019/2/20		4	4		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月20日の予定

*1月の貿易統計	*米国1月の住宅着工件数(延期)	*交付税特別会計借入(10,500億円、2/28借入)
----------	------------------	-----------------------------

◆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