

Central Daily Market Report

2019年2月21日(木)
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21日		2019年2月22日		2019年2月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 1,400		1,000		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 3,000		▲ 100		▲ 3,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200			500	
E T F 買入	600					
国債補完供給						
当預増減	▲ 2,700		4,600		▲ 5,800	
当座預金残高	3,830,700		3,835,300		3,829,500	
準備預金残高	3,339,200					
積み終了先	3,336,400				2月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,333,200				積数 10,300	
非準備預金先	491,500				1日平均 500	
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		99.63%		日数 21.43%	

●2019年2月21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。引き続き地銀業態を中心に資金調達ニーズが底堅く、一巡後は▲0.086~▲0.060%で調整の出会いが散見された。ターム物に関しては特段の出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(2/21-2/22)は▲0.11~▲0.095%程度、T/N(2/22-2/25)は▲0.11~▲0.095%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、30Y59~61、40Y11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、短国買入オペアが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が2兆円弱と多く、平均落札利回較差+0.024%、按分落札利回較差+0.012%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りからか、引き続き弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.208~▲0.207%、6M物が▲0.223%、1Y物が▲0.210~▲0.205%で出会った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、五十日発行にあたり、ノンバンク・石油・鉄鋼等の業態で大型案件がみられ、償還総額3,400億円程度に対して、発行総額は3,800億円程度と若干の発行超となった。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

2019/2/21	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	▲ 0.056				-	▲ 0.102	▲ 0.045	▲ 0.005	21,464.23	32.74	110.75-76	110.76-77
T/N	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.117						
2W							-	▲ 0.121						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.125						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.208	▲ 0.161						
6M							▲ 0.222	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.206	▲ 0.164						
									日付	2/14	2/15	2/18	2/19	2/20
									日銀当預残	3,756,400	3,847,100	3,841,400	3,853,600	3,833,400
									準備預金残	3,326,600	3,359,100	3,351,800	3,362,900	3,337,100
									マネタリーベース	4,869,700	4,960,300	4,954,100	4,966,400	4,946,700
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.057%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.058%
									コール市場残高	110,259	91,875	103,747	101,157	107,605
									うち無担	78,820	73,092	80,256	83,490	80,994
									うちO/N	51,985	50,427	53,741	56,725	54,549
									うち有担	31,439	18,783	23,491	17,667	26,611

●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)
流動性供給	279	-	6,000	2019/2/22		20,080.0	5,961.0		▲0.0070%	58.9938%		▲0.0080%	

●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	2019/2/22			19,638	5,005	0.012		0.024	21.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	46,654	2019/2/21	2019/2/22		41	41		▲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	2019/2/21	2019/2/22		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月22日の予定

1月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%	*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(816回)入札 (3ヶ月、43,400億円、2/25発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、3/6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