Central Daily Market Report

2019年2月22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22日 需給速報		2019年2月25日 需給予想		2019年2月26日 当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 200		▲ 1,000	
財政	800		900		2,000	
資金過不足	▲ 400		700		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			4,900	▲ 3,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			7,200			
CP等買入		▲ 300		▲ 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			500			
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給						
当預増減	4,300		9,800		1,000	

当座預金残高	3,835,000	3,844,800	3,845,800
準備預金残高	3,352,600		
積み終了先	3,352,200		
超過準備	3,350,800		
非準備預金先	482,400		

2月25日以降の残り所要積立額	
積数	4,900
1日平均	300

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	99.83%	日数 32.14%

●2019年2月22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%の出合いが中心となった。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～▲0.065%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.040～▲0.030%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(2/22-2/25)は▲0.10～▲0.095%程度、T/N(2/25-2/26)は▲0.105～▲0.06%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)は上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.218%から一時▲0.225%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.2207%、按分落札利回▲0.2065%とWI取引を反映した強めの結果となった。セカンダリーマーケットは、足元GCレートの上昇を受けてか、全般的に小甘く推移した。3M物が▲0.220～▲0.210%、6M物が▲0.222%、1Y物が▲0.205%で少額出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、ノンバンク業態で大型案件がみられ、償還総額500億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と大幅な発行超となった。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

2019/2/22	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.058				－	▲ 0.092
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.030				－	▲ 0.098
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.025				－	▲ 0.106
3W							－	▲ 0.115
1M							－	▲ 0.128
3M							▲ 0.210	▲ 0.158
6M							▲ 0.222	▲ 0.164
1Y							▲ 0.207	▲ 0.164

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.045	0.000	21,425.51	▲ 38.72	110.70-72	110.74-75

日付	2/15	2/18	2/19	2/20	2/21
日銀当預残	3,847,100	3,841,400	3,853,600	3,833,400	3,830,700
準備預金残	3,359,100	3,351,800	3,362,900	3,337,100	3,340,300
マネタリーベース	4,960,300	4,954,100	4,966,400	4,946,700	4,945,600
無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.056%
コール市場残高	91,875	103,747	101,157	107,605	115,430
うち無担	73,092	80,256	83,490	80,994	87,432
うちO/N	50,427	53,741	56,725	54,549	60,677
うち有担	18,783	23,491	17,667	26,611	27,998

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	816	－	43,400	2019/2/25	2019/6/3	136,223.8	35,208.6	100.0555	▲0.2065%	49.0820%	100.0593	▲0.2207%	8,191.0
交付税特会	－	－	10,500	2019/3/6	2019/9/4	277,384.0	10,500.14		0.0000%	3.8019%		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	2019/2/25	2019/3/11		4,916	4,916				
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,300	2019/2/25			10,779	4,304	▲0.005		▲0.003	41.8
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,800	2019/2/25			4,164	1,802	▲0.007		▲0.003	38.7
国債買入（残存期間25年超）	500	2019/2/25			1,655	507	0.006		0.006	87.4
国債買入（物価連動債）	250	2019/2/25			1,287	251	▲0.020		▲0.076	100
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,000	2019/2/22	2019/2/25		40	40		▲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	2019/2/22	2019/2/25		2	2		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月25日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況
*1月の企業向けサービス価格指数

◆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論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