

Central Daily Market Report

2019年2月27日(水)
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27日		2019年2月28日		2019年3月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 8,800		5,300		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 9,800		4,200		▲ 32,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入			12,000			
CP等買入		▲ 200	2,000	▲ 1,800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入		▲ 100				
E T F 買入			700			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 7,600		17,200		▲ 32,000	
当座預金残高	3,838,500		3,855,700		3,823,700	
準備預金残高	3,359,700					
積み終了先	3,359,400					
超過準備	3,359,300					
非準備預金先	478,800					
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,820,000	
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	42.86%		

●2019年2月27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▲0.065~▲0.045%で調整の出会いが散見された。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.045~▲0.015%程度の出会いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(2/27-2/28)は▲0.07~▲0.055%程度、T/N(2/28-3/1)は▲0.060~▲0.045%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、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。アウトライト市場は、足元ファンディングレートの上昇もあってか、3M物で▲0.195~▲0.181%と引け値よりもレートの高い水準での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、その他金融・小売業態でまとまった額での発行が見られた。発行総額2,100億円程度に対し、償還総額は2,300億円程度と若干の償還超のマーケットとなった。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

2019/2/27	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.060	▲ 0.029	0.001	21,556.51	107.12	110.54-56	110.37-39
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.067						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.075						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.050				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.189	▲ 0.148						
6M							▲ 0.218	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.203	▲ 0.160						
									日付	2/20	2/21	2/22	2/25	2/26
									日銀当預残	3,833,400	3,830,700	3,835,000	3,847,400	3,846,100
									準備預金残	3,337,100	3,340,300	3,353,200	3,371,000	3,355,500
									マネタリーベース	4,946,700	4,945,600	4,951,100	4,963,900	4,963,500
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.056%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.052%
									コール市場残高	107,605	115,430	125,854	117,603	102,951
									うち無担	80,994	87,432	95,105	92,838	80,063
									うちO/N	54,549	60,677	59,120	56,743	53,823
									うち有担	26,611	27,998	30,749	24,765	22,888

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/3/8	2019/9/6	279,527.0	10,500.02		0.0000%	3.7564%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/2/28			13,579	3,503	0.003		0.005	28.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/2/28			16,799	4,005	▲0.002		▲0.001	34.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/2/28			13,735	4,312	▲0.004		▲0.003	23.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	13,985	2019/2/27	2019/2/28		69	69		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第35回	2019/3/4	2023/3/3	0	2,852
成長基盤強化	ABL等特別第31期	2019/3/6	2023/3/6	0	1
成長基盤強化	小口特別第28期	2019/3/4	2023/3/3	0	6.80
成長基盤強化	米ドル特別第27期	2019/3/5	2020/3/5		575
成長基盤強化	米ドル特別第23期(借り換え)	2019/3/5	2020/3/5		1,167
成長基盤強化	米ドル特別第19期(借り換え)	2019/3/5	2020/3/5		3,781
成長基盤強化	米ドル特別第15期(借り換え)	2019/3/5	2020/3/5		151

●2019年2月28日の予定

*鈴木日銀審議委員、茨城県金融経済懇談会にて講演	*米国10-12月期のGDP改定値	*2年利付国債入札
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲2.5%)	*米国2月のシカゴPM景況感指数	(21,000億円、3/1発行)
*1月の商業動態統計速報 *1月の住宅着工統計		

◆本資料は信頼できるとさ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