

Central Daily Market Report

2019年2月28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28日 需給速報	2019年3月1日 需給予想	2019年3月4日 当社予想			
銀行券	▲ 1,200	▲ 400	1,000			
財政	4,700	▲ 37,200	▲ 44,000			
資金過不足	3,500	▲ 37,600	▲ 43,000			
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,000					
CP等買入	2,000	▲ 1,800		▲ 300		
貸出支援基金(成)					2,900	▲ 6,500
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
E T F 買入	700					
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	16,200	▲ 37,600		▲ 47,300		
当座預金残高	3,854,700	3,817,100		3,769,800		
準備預金残高	3,366,700					
積み終了先	3,366,400				3月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,366,400				積数	3,000
非準備預金先	488,000				1日平均	200
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						2,818,000
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	46.43%		

●2019年2月28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~▲0.025%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~▲0.030%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(2/28-3/1)は▲0.075~▲0.040%程度、T/N(3/1-3/4)は▲0.055~▲0.030%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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物で▲0.191%、6M物で▲0.215%、1Y物で▲0.200%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、その他金融・鉄鋼業態等で大型案件が実施され、発行総額2,100億円程度に対し、償還総額は2,500億円程度と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

2019/2/28	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	▲ 0.055				-	▲ 0.049	▲ 0.030	▲ 0.001	21,385.16	▲ 171.35	110.87-88	110.75-76
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.049						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.012	▲ 0.021				-	▲ 0.056						
2W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.063						
3W							-	▲ 0.085						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.191	▲ 0.142						
6M							▲ 0.215	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.157						
									日付	2/21	2/22	2/25	2/26	2/27
									日銀当預残	3,830,700	3,835,000	3,847,400	3,846,100	3,838,500
									準備預金残	3,340,300	3,353,200	3,371,000	3,355,500	3,359,700
									マネタリーベース	4,945,600	4,951,100	4,963,900	4,963,500	4,956,900
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.052%	▲0.050%
									コール市場残高	115,430	125,854	117,603	102,951	104,015
									うち無担	87,432	95,105	92,838	80,063	80,897
									うちO/N	60,677	59,120	56,743	53,823	54,327
									うち有担	27,998	30,749	24,765	22,888	23,118

●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)
2年利付国債	398	0.10%	21,000	2019/3/1	2021/3/1	90,186.0	17,124.00	100.5050	▲0.1510%	34.0471%	100.5110	▲0.1540%	3,872.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	77,159	2019/2/28	2019/3/1		328	328		▲0.600	▲0.600	

●2019年3月1日の予定

*10-12月期の法人企業統計調査季報	*米国12月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(817回)入札(3ヶ月、43,600億円、3/4発行)
*1月の完全失業率(市場予想：2.4%)	*米国1月の個人所得(消費支出は無し)	
*1月の有効求人倍率(市場予想：1.63倍)	*米国2月のISM製造業景況指数	
*2月の都区部消費者物価指数(CPI)	*ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値	
市場予想：前年同月比(除く生鮮)+1.0%		
*2月の消費動向調査		

◆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