

# Central Daily Market Report

2020年2月3日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2020年2月3日		2020年2月4日		2020年2月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		900		1,000	
財政	▲ 28,400		▲ 79,200		▲ 21,000	
資金過不足	▲ 27,600		▲ 78,300		▲ 20,000	
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						
国債買入						
CP等買入						
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			500			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 27,500		▲ 77,700		▲ 20,000	
当座預金残高	4,005,400		3,927,700		3,907,700	
準備預金残高	3,481,400					
積み終了先	3,479,700					
超過準備	3,479,600				2月4日以降の残り所要積立額 積数 4,300	
非準備預金先	524,000				1日平均 400	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,236,300	
準備預金進捗率	実績	99.87%	日数	61.29%		

## ●2020年2月3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▲0.035~▲0.015%の出会いが中心となった。前営業日は月末要因で出会いレートが低下していたものの、積み期後半に入り、引き続き高い水準となった。一巡後は▲0.06~▲0.035%近辺で散発的な出会いが見られた。ターム物は、オファーサイドが少なく閑散なマーケットとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/4-2/5)は、▲0.060~▲0.045%程度での出会い。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2Y402~409、10Y335~357、5Y136~142、20Y167~171、30Y59~65、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、上昇。アウトライト市場は、3M物が▲0.145~▲0.135%出会いと堅調に推移した。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額2,000億円程度に対して、発行総額は500億円程度と償還超であった。案件数はあまり膨らまず、小型案件が中心の落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/2/3	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.064	▲ 0.065	0.000	22,971.94	▲ 233.24	108.38-39	108.62-63
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.050						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.057						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.065						
3W							-	▲ 0.071						
1M							-	▲ 0.080						
3M							▲ 0.145	▲ 0.100						
6M							▲ 0.151	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.158						
									日付	1/27	1/28	1/29	1/30	1/31
									日銀当預残	4,010,400	4,010,900	4,016,900	4,034,300	4,032,900
									準備預金残	3,481,700	3,482,800	3,488,400	3,501,200	3,510,400
									マネタリーベース	5,151,200	5,151,200	5,156,800	5,174,000	5,172,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.020%	▲ 0.025%	▲ 0.032%	▲ 0.039%
									コール市場残高	97,941	103,631	100,956	108,859	105,677
									うち無担	78,501	84,423	83,852	91,503	87,794
									うちO/N	50,601	55,823	55,857	62,788	61,309
									うち有担	19,440	19,208	17,104	17,356	17,883

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)		2020/2/3	2020/2/4	▲ 0.350	117	117		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/2/3	2020/2/4	▲ 0.350	13	13		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2020年2月4日の予定

*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支	*米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(21,000億円、2/5発行)
*1月のマネタリーベース		

◆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お客様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