

Central Daily Market Report

2020年2月4日(火)

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4日		2020年2月5日		2020年2月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		700		0	
財政	▲ 81,700		▲ 21,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 80,800		▲ 21,000		▲ 2,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
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	▲ 400	100		400		
当預増減	▲ 80,600		▲ 13,200		▲ 2,000	
当座預金残高	3,924,800		3,911,600		3,909,600	
準備預金残高	3,413,200					
積み終了先	3,412,900		2月5日以降の残り所要積立額		積数 3,300	
超過準備	3,412,200		1日平均		300	
非準備預金先	511,600					
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	99.90%	日数	64.52%		

●2020年2月4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▲0.02~▲0.01%の出合いが中心となった。税揚げ要因により大幅な資金不足日となったこともあり、昨日よりも調達レートが上昇した。一巡後は▲0.04~▲0.02%近辺での出合いが見られる中で、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/5-2/6)は、▲0.090~▲0.070%程度での出合い。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、低下。アウトライト市場では、短国買入オペが市場予想を若干上回る7,500億円でおファーされ、平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.000%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、3M物で▲0.1425~▲0.140%で出合いが見られた。

<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600億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超であった。案件数はあまり膨らまず小型案件を中心とする落ち着いたマーケットであった。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

2020/2/4	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	▲ 0.023				-	▲ 0.073	▲ 0.055	0.010	23,084.59	112.65	108.62-63	108.93-94
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.002	▲ 0.003				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.005	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.074						
3W			0.001				-	▲ 0.079						
1M			0.000				-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.149	▲ 0.104						
6M			0.000				▲ 0.148	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.158						
									日付	1/28	1/29	1/30	1/31	2/3
									日銀当預残	4,010,900	4,016,900	4,034,300	4,032,900	4,005,400
									準備預金残	3,482,800	3,488,400	3,501,200	3,510,400	3,481,800
									マネタリーベース	5,151,200	5,156,800	5,174,000	5,172,100	5,143,800
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.025%	▲0.032%	▲0.039%	▲0.033%
									コール市場残高	103,631	100,956	108,859	105,677	111,701
									うち無担	84,423	83,852	91,503	87,794	91,668
									うちO/N	55,823	55,857	62,788	61,309	63,143
									うち有担	19,208	17,104	17,356	17,883	20,033

●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)
10年利付国債	357	0.10%	21,000	2020/2/5	2029/12/20	61,580.0	16,943.00	101.4800	▲0.0490%	77.1508%	101.5000	▲0.0510%	4,047.0

●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
国庫短期証券買入	7,500	2020/2/5			18,024	7,502	0.000		0.006	3.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/4	2020/2/5	▲ 0.350	392	392		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/2/6	2020/2/14	2.090	7	7				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/2/5	2020/2/17		6	6		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年2月5日の予定

*若田部日銀副総裁、愛媛県金融経済懇談会において講演	*米国12月の貿易収支 *米国1月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、2/19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