

# Central Daily Market Report

2020年2月5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	2020年2月5日		2020年2月6日		2020年2月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲ 300				0
財政	▲ 21,700	500				▲ 3,000
資金過不足	▲ 21,100	200				▲ 3,000
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		▲ 200		
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						
国債補完供給		400				
当預増減	▲ 13,300	0				▲ 3,000
当座預金残高	3,911,500	3,911,500				3,908,500
準備預金残高	3,390,900					
積み終了先	3,390,500					
超過準備	3,390,500				2月6日以降の残り所要積立額 積数	2,900
非準備預金先	520,600				1日平均	300
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	99.91%	日数	67.74%		

## ●2020年2月5日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.015~▲0.01%前後の出合い。昨日に続き資金調達サイドから取り上がる動きも散見された。また、試し取りが行われたことで、0.001%の出合いも見られた。一巡後もほぼ同水準の▲0.035~▲0.015%程度で推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/6-2/7)は、▲0.100~▲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、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、3M物が▲0.152~▲0.144%出合いでの推移となった。一方で、明日発行の6M(886回)のWI取引では▲0.135%と軟調な出合いが見られた。

### <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300億円程度に対して、発行総額は1,200億円程度と発行超であった。一部のその他金融業態において大型発行があったものの、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

2020/2/5	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.091	▲ 0.040	0.015	23,319.56	234.97	109.44-45	109.33-34
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.083						
2W							-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.144	▲ 0.107						
6M							▲ 0.148	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.159						
									日付	1/29	1/30	1/31	2/3	2/4
									日銀当預残	4,016,900	4,034,300	4,032,900	4,005,400	3,924,800
									準備預金残	3,488,400	3,501,200	3,510,400	3,481,800	3,414,500
									マネタリーベース	5,156,800	5,174,000	5,172,100	5,143,800	5,062,300
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.032%	▲0.039%	▲0.033%	▲0.023%
									コール市場残高	100,956	108,859	105,677	111,701	107,585
									うち無担	83,852	91,503	87,794	91,668	87,874
									うちO/N	55,857	62,788	61,309	63,143	58,249
									うち有担	17,104	17,356	17,883	20,033	19,711

## ●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	2020/2/19	2020/8/21	222,945.0	10,500.01		0.0000%	4.7098%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/5	2020/2/6	▲ 0.350	3	3		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2020年2月6日の予定

*政井日銀審議委員、奈良県金融経済懇談会において講演	*国庫短期証券(886回)入札 (6ヶ月、26,000億円、2/10発行)
	*30年利付国債入札 (7,000億円、2/7発行)

◆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