

Central Daily Market Report

2020年2月6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	2020年2月6日		2020年2月7日		2020年2月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		400		1,000	
財政	800		▲ 10,400		▲ 5,000	
資金過不足	500		▲ 10,000		▲ 4,000	
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						▲ 7,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
国債補完供給	▲ 200		200			
当預増減	100		▲ 9,900		▲ 11,000	
当座預金残高	3,911,600		3,901,700		3,890,700	
準備預金残高	3,388,700					
積み終了先	3,388,200					
超過準備	3,388,200					
非準備預金先	522,900					
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	99.93%	日数	70.97%		

●2020年2月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nの立ち上がりは、邦銀を中心に▲0.01%の出合い。引き続き資金調達意欲が強く、高い水準での取引が中心となった。一巡後は▲0.03~▲0.01%で散発的な出合いが見られた。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。ターム物は、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/7-2/10)は、▲0.095~▲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、小幅上昇。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.135~▲0.130%で出合中、平均落札利回▲0.1395%、按分落札利回▲0.1375%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.155%出合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1,700億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と償還超であった。一部の鉄鋼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

2020/2/6	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.016				-	▲ 0.086	▲ 0.020	0.020	23,873.59	554.03	109.81-82	109.90-91
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.090						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.084						
2W							-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.086						
1M			▲ 0.003				-	▲ 0.092						
3M			0.070				▲ 0.145	▲ 0.107						
6M							▲ 0.160	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.159						
									日付	1/30	1/31	2/3	2/4	2/5
									日銀当預残	4,034,300	4,032,900	4,005,400	3,924,800	3,911,500
									準備預金残	3,501,200	3,510,400	3,481,800	3,414,500	3,390,900
									マネタリーベース	5,174,000	5,172,100	5,143,800	5,062,300	5,048,300
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.039%	▲0.033%	▲0.023%	▲0.015%
									コール市場残高	108,859	105,677	111,701	107,585	108,860
									うち無担	91,503	87,794	91,668	87,874	89,297
									うちO/N	62,788	61,309	63,143	58,249	60,217
									うち有担	17,356	17,883	20,033	19,711	19,563

●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)
国庫短期証券	886	-	26,000	2020/2/10	2020/8/11	80,820.7	21,105.4	100.0690	▲0.1375%	69.3986%	100.0700	▲0.1395%	4,894.0
30年利付国債	65	0.40%	7,000	2020/2/7	2049/12/20	21,077.0	5,650.0	99.2500	0.4280%	70.0249%	99.3000	0.4260%	1,344.0

●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)		2020/2/6	2020/2/7	▲0.350	184	184		▲0.350	▲0.350	

●2020年2月7日の予定

- | | | |
|--------------------------------------|----------------|--|
| *12月の全世帯家計調査
(市場予想：消費支出、前年比▲1.7%) | *米国12月の卸売売上高 | *国庫短期証券(887回)入札
(3ヶ月、44,400億円、2/10発行) |
| *12月の毎月勤労統計調査速報 | *米国12月の消費者信用残高 | *エネルギー対策借入
(5,000億円、2/20借入) |
| *12月の景気動向指数速報 | *米国1月の雇用統計 | |
| *1月のマネタリーベースと日本銀行の取引 | | |

◆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