

Central Daily Market Report

2020年2月7日(金)

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7日		2020年2月10日		2020年2月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		400		1,000	
財政	▲ 11,300		▲ 8,200		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 10,800		▲ 7,800		0	
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			5,800	▲ 7,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,800			
CP等買入		▲ 100		▲ 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			800			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 10,800		3,600		0	
当座預金残高	3,900,800		3,904,400		3,904,400	
準備預金残高	3,383,800					
積み終了先	3,383,500				2月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,383,300				積数	
非準備預金先	517,000				1日平均	
					200	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,241,200	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	80.65%		

●2020年2月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み期間も終盤を迎える中、週末要因も重なったことで調達意欲は強く、邦銀を中心に▲0.01~▲0.008%の出会い。一巡後の出会い水準は▲0.02~▲0.01%程度で推移した。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(2/10-2/12)は、▲0.065~▲0.040%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、5Y136~142、10Y335~357、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、発行日要因もあってか、上昇。アウトライイト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.137~▲0.132%で出合う中、平均落札利回▲0.1367%、按分落札利回▲0.1323%と、WI取引を反映してか、落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.144~▲0.140%出会いと堅調に推移した。この他に、6M物で▲0.158%、1Y物で▲0.170%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は発行・償還総額共に1,500億円程度であった。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

2020/2/7	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	▲ 0.014				-	▲ 0.062	▲ 0.040	▲ 0.020	23,827.98	▲ 45.61	109.96-97	109.92-93
T/N							-	▲ 0.056						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.002	▲ 0.002				-	▲ 0.060						
2W							-	▲ 0.068						
3W							-	▲ 0.077						
1M			0.000				-	▲ 0.085						
3M							▲ 0.142	▲ 0.103						
6M							▲ 0.159	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.159						
									日付	1/31	2/3	2/4	2/5	2/6
									日銀当預残	4,032,900	4,005,400	3,924,800	3,911,500	3,911,600
									準備預金残	3,510,400	3,481,800	3,414,500	3,390,900	3,388,800
									マネタリーベース	5,172,100	5,143,800	5,062,300	5,048,300	5,048,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.033%	▲ 0.023%	▲ 0.015%	▲ 0.016%
									コール市場残高	105,677	111,701	107,585	108,860	114,687
									うち無担	87,794	91,668	87,874	89,297	95,330
									うちO/N	61,309	63,143	58,249	60,217	66,165
									うち有担	17,883	20,033	19,711	19,563	19,357

●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	887	-	44,400	2020/2/10	2020/5/11	121,678.4	36,198.40	100.0330	▲0.1323%	71.7102%	100.0341	▲0.1367%	8,201.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2020/2/20	2021/2/22	99,100.0	4,999.98		0.0000%	5.0455%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2020/2/10	2020/2/25		5,848	5,848				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/2/10			4,897	4,200	▲0.048		▲0.010	66.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/2/10			9,473	3,409	▲0.010		▲0.008	41.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/2/10			6,696	3,506	▲0.019		▲0.016	29.5
国債買入(物価連動債)	300	2020/2/10			1,502	301	▲0.020		▲0.059	32.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/7	2020/2/10	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/2/7	2020/2/10	▲ 0.350	65	65		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年2月10日の予定

- *12月の国際収支
- *12月の特定サービス産業動態統計速報
- *1月の景気ウォッチャー調査

◆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