Central Daily Market Report

2020年2月12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12日 需給速報		2020年2月13日 需給予想		2020年2月14日 当社予想	
銀行券	900		▲ 400		0	
財政	▲ 600		▲ 5,500		74,000	
資金過不足	300		▲ 5,900		74,000	
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	2,300					
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						
ＥＴＦ買入	500		200			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	3,000		1,800		74,000	

当座預金残高	3,911,000	3,912,800	3,986,800
準備預金残高	3,404,800		
積み終了先	3,404,700		
超過準備	3,404,600		
非準備預金先	506,200		

2月13日以降の残り所要積立額	
積数	500
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	99.98%	日数 90.32%

●2020年2月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日を控え引き続き調達意欲は旺盛なマーケットとなり、邦銀業態を中心に▲0.01～▲0.005%の出合いが中心であった。一巡後も▲0.005%の調達希望が残る状況となった。ターム物については、出合いは閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(2/13-2/14)は、▲0.105～▲0.075%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、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、低下。アウトライト市場では、短国買入オペが前回と同額の7,500億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.005%と、小甘い結果となった。マーケットでは、3M物で▲0.142%、6M物で▲0.160%、1Y物で▲0.170%出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は建設、ゴム、機械業態で大型発行があったが、減額ロールあるいはロールしない先が散見され、償還総額2,300億円程度に対して、発行総額は2,100億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/2/12	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.008				－	▲ 0.077
T/N							－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W			▲ 0.010				－	▲ 0.083
2W							－	▲ 0.083
3W							－	▲ 0.086
1M							－	▲ 0.091
3M							▲ 0.145	▲ 0.103
6M			0.020				▲ 0.160	▲ 0.133
1Y							▲ 0.170	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.045	0.015	23,861.21	175.23	109.84-85	109.87-88

日付	2/4	2/5	2/6	2/7	2/10
日銀当預残	3,924,800	3,911,500	3,911,600	3,900,800	3,908,000
準備預金残	3,414,500	3,390,900	3,388,800	3,384,000	3,399,800
マネタリーベース	5,062,300	5,048,300	5,048,700	5,037,400	5,044,300
無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.010%
コール市場残高	107,585	108,860	114,687	121,023	109,495
うち無担	87,874	89,297	95,330	101,779	90,381
うちO/N	58,249	60,217	66,165	65,744	53,896
うち有担	19,711	19,563	19,357	19,244	19,114

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
物価連動10年	24	0.10%	4,000	2020/2/13	2029/3/10	14,999.0	3,995.00	102.3000	▲0.1500%	8.4317%			

●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	2020/2/13			24,516	7,503	0.005		0.007	28.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/2/12	2020/2/13	▲ 0.350	64	64		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/2/14	2020/2/21	2.080	4	4				

●2020年2月13日の予定

*1月の企業物価指数　　*米国1月の消費者物価指数

◆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。
◆本資料は何ら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論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