Central Daily Market Report

2020年2月14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14日 需給速報		2020年2月17日 需給予想		2020年2月18日 当社予想	
銀行券	300		500		0	
財政	74,100		300		▲ 1,000	
資金過不足	74,400		800		▲ 1,000	
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						
国債買入	12,400					
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						
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	86,700		1,400		▲ 1,000	
当座預金残高	3,998,800		4,000,200		3,999,200	
準備預金残高	3,478,400					
積み終了先	3,478,400		2月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,478,200		積数	515,100		
非準備預金先	520,400		1日平均	18,400		
積み期間（2/16～3/15）の所要準備額					3,026,800	
準備預金進捗率	実績	82.98%	日数	3.45%		

●2020年2月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀・信託・証券業態を中心に▲0.015～▲0.005%での調達で始まった。年金定時払いで大幅な資金余剰日であるものの、積みの実質的な最終日ということもあって、着地に向けた調整の調達ニーズが強く、一巡後も▲0.02%前後のレートで出合いが見られた。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(2/17-2/18)は、▲0.08～▲0.065%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、上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.133～▲0.130%で出合う中、平均落札利回▲0.1283%、按分落札利回▲0.1222%と、軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.123～▲0.120%出合いと弱含みで推移した。この他に、6M物が▲0.162～▲0.160%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は小売業態で大型発行があり、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

2020/2/14	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.011				－	▲ 0.077
T/N							－	▲ 0.075
S/N							－	－
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.009				－	▲ 0.075
2W			0.000				－	▲ 0.078
3W			0.000				－	▲ 0.083
1M	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.013				－	▲ 0.092
3M							▲ 0.122	▲ 0.102
6M							▲ 0.160	▲ 0.133
1Y							▲ 0.170	▲ 0.158

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)
▲ 0.035	0.000	23,687.59	▲ 140.14	109.77-78	109.78-79

日付	2/6	2/7	2/10	2/12	2/13
日銀当預残	3,911,600	3,900,800	3,908,000	3,911,000	3,912,100
準備預金残	3,388,800	3,384,000	3,399,800	3,404,500	3,397,900
マネタリーベース	5,048,700	5,037,400	5,044,300	5,046,400	5,047,700
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.014%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.008%
コール市場残高	114,687	121,023	109,495	103,448	108,683
うち無担	95,330	101,779	90,381	84,793	89,837
うちO/N	66,165	65,744	53,896	57,878	63,012
うち有担	19,357	19,244	19,114	18,655	18,846

●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)
国庫短期証券	888	－	44,400	2020/2/17	2020/5/18	109,641.6	36,122.4	100.0305	**▲0.1222%**	**89.6837%**	100.0320	**▲0.1283%**	8,277.0
流動性供給	303	－	6,000	2020/2/17		15,934.0	5,979.0		**0.0050%**	**38.5105%**		**0.0030%**	
国有林野借入	－	－	962	2020/2/25	2025/2/25	2,425.0	962.00		**0.0000%**	**50.0000%**		**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)		2020/2/14	2020/2/17	▲ 0.350	85	85		▲0.350	▲0.350	

●2020年2月17日の予定

*10-12月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率▲3.7%)
*12月の石油等消費動態統計

◆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