

Central Daily Market Report

2020年2月17日(月)
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17日 需給速報	2020年2月18日 需給予想	2020年2月19日 当社予想			
銀行券	500	0	0			
財政	400	▲ 1,300	▲ 23,000			
資金過不足	900	▲ 1,300	▲ 23,000			
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						
CP等買入		▲ 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	700					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	1,400	▲ 1,200		▲ 23,000		
当座預金残高	4,000,200	3,999,000		3,976,000		
準備預金残高	3,472,800					
積み終了先	3,387,100				2月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,056,700				積数	98.900
非準備預金先	527,400				1日平均	3.700
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	96.73%	日数	6.90%		

●2020年2月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期に入ったことで、一部では様子見の動きも見られ、立ち上がりは地銀・信託・証券業態から▲0.07~▲0.01%の出合い。一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物は、オファーサイドが少なく閑散なマーケットとなった。

<レポ市場>

GC T/N(2/18-2/19)は、▲0.10~▲0.08%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、新積み期に入り、低下。アウトライト市場は、3M物が▲0.125~▲0.122%、6M物が▲0.160%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、電気機器業態で比較的多まった額の調達が行われ、発行総額は600億円程度と償還総額の100億円程度を上回った。発行レートについては、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/2/17	無担(速報)			有担(速報)			短期 売買参考値	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.086	▲ 0.040	▲ 0.005	23,523.24	▲ 164.35	109.78-79	109.86-87
T/N			0.001				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.003				-	▲ 0.086						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.087						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.126	▲ 0.102						
6M							▲ 0.159	▲ 0.132						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.158						
									日付	2/7	2/10	2/12	2/13	2/14
									日銀当預残	3,900,800	3,908,000	3,911,000	3,912,100	3,998,800
									準備預金残	3,384,000	3,399,800	3,404,500	3,397,900	3,478,600
									マネタリーベース	5,037,400	5,044,300	5,046,400	5,047,700	5,134,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.011%
									コール市場残高	121,023	109,495	103,448	108,683	103,638
									うち無担	101,779	90,381	84,793	89,837	85,069
									うちO/N	65,744	53,896	57,878	63,012	55,204
									うち有担	19,244	19,114	18,655	18,846	18,569

●入札結果

名称	回数	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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)		2020/2/17	2020/2/18	▲ 0.350	71	71		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年2月18日の予定

*5年利付国債入札 (19,000億円、2/19発行)

◆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