

# Central Daily Market Report

2020年2月19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19日		2020年2月20日		2020年2月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	▲ 21,600		▲ 2,000		3,000	
資金過不足	▲ 22,200		▲ 3,400		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	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 100		3,500
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	600		100			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 16,600		▲ 3,300		4,500	
当座預金残高	3,984,600		3,981,300		3,985,800	
準備預金残高	3,460,500					
積み終了先	3,449,200					
超過準備	3,446,400				2月20日以降の残り所要積立額 積数 32,400	
非準備預金先	524,100				1日平均 1,300	
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	98.93%	日数	13.79%		

## ●2020年2月19日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き資金調達意欲が強く、立ち上がりは国内勢を中心に▲0.05~▲0.008%のレンジでの出会い。一巡後は▲0.055~▲0.015%の出会いが見られた程度であった。ターム物は閑散であった。

### <レポ市場>

GCT/N(2/20-2/21)は、▲0.07~▲0.05%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等にビッグの出入りがあった。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、上昇。アウトライ市場は、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.143~▲0.140%で出合う中、平均落札利回▲0.1465%、按分落札利回▲0.1436%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、▲0.160%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.129~▲0.128%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は卸売や食品、不動産等の幅広い業態でまとまった額の発行が散見され、発行総額は4,100億円程度と償還総額の3,300億円程度を上回った。発行レートについては、発行残高が積み上がっている銘柄で僅かに上昇したが、全般的には横ばい圏で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2020/2/19	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.063	▲ 0.050	0.005	23,400.70	206.90	109.91-93	110.11-12
T/N	▲ 0.005	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.062						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.067						
2W			0.000				-	▲ 0.070						
3W							-	▲ 0.078						
1M							-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.127	▲ 0.101						
6M							▲ 0.162	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.156						
									日付	2/12	2/13	2/14	2/17	2/18
									日銀当預残	3,911,000	3,912,100	3,998,800	4,000,200	4,001,200
									準備預金残	3,404,500	3,397,900	3,478,600	3,472,900	3,475,600
									マネタリーベース	5,046,400	5,047,700	5,134,200	5,135,100	5,136,100
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.008%	▲0.011%	▲0.025%	▲0.018%
									コール市場残高	103,448	108,683	103,638	110,990	113,283
									うち無担	84,793	89,837	85,069	92,953	94,548
									うちO/N	57,878	63,012	55,204	63,993	64,158
									うち有担	18,655	18,846	18,569	18,037	18,735

## ●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	889	-	19,000	2020/2/20	2021/2/22	65,437.0	15,508.8	100.1450	▲0.1436%	66.6363%	100.1480	▲0.1465%	3,491.0
交付税特会	-	-	10,500	2020/2/28	2020/8/31	229,036.0	10,500.03		0.0000%	4.5845%		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)		2020/2/19	2020/2/20	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/2/19	2020/2/20	▲ 0.350	130	130		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/2/21	2020/2/27	2.080	1	1				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第106回 2020/2/21	2021/2/19	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第45回 2020/2/21	2021/2/19	0	0

## ●2020年2月20日の予定

*20年利付国債入札 (9,000億円、2/21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