

Central Daily Market Report

2020年2月20日(木)
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20日		2020年2月21日		2020年2月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 3,600		4,400		2,000	
資金過不足	▲ 5,000		3,200		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						▲ 5,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100	3,500	▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 100		
ETF買入	100					
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 4,900		5,800		▲ 4,800	
当座預金残高	3,979,700		3,985,500		3,980,700	
準備預金残高	3,446,400					
積み終了先	3,437,700					
超過準備	3,437,200					
非準備預金先	533,300					
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	99.23%	日数	17.24%		

●2020年2月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態を中心に▲0.05～▲0.005%の出合い。前日同様に資金調達意欲は強く、レートは高止まりの展開となった。一巡後は散発的な出合いが散見された程度であった。ターム物は、オファーサイドが少なく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(2/21-2/25)は、▲0.08～▲0.06%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行となり、ノンバンク、卸売、ガラス・土石製品等の業態でまとまった額の調達が行われ、発行総額は2,400億円程度と償還総額の1,200億円程度を上回った。発行レートは概ね横ばい圏で推移したものの、一部銘柄においてはレートが若干上昇する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/2/20	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.061	▲ 0.045	0.005	23,479.15	78.45	111.20-21	111.68-69
T/N			0.001				-	▲ 0.067						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.009	0.230	0.000				-	▲ 0.069						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.073						
3W							-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.127	▲ 0.102						
6M							▲ 0.162	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.157						
									日付	2/13	2/14	2/17	2/18	2/19
									日銀当預残	3,912,100	3,998,800	4,000,200	4,001,200	3,984,600
									準備預金残	3,397,900	3,478,600	3,472,900	3,475,600	3,461,400
									マネタリーベース	5,047,700	5,134,200	5,135,100	5,136,100	5,120,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.008%	▲ 0.011%	▲ 0.025%	▲ 0.018%	▲ 0.017%
									コール市場残高	108,683	103,638	110,990	113,283	117,726
									うち無担	89,837	85,069	92,953	94,548	97,614
									うちO/N	63,012	55,204	63,993	64,158	67,349
									うち有担	18,846	18,569	18,037	18,735	20,112

●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)
20年利付国債	171	0.30%	9,000	2020/2/21	2039/12/20	28,946.0	7,263.0	101.2500	0.2340%	81.9560%	101.2700	0.2320%	1,728.0

●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
社債等買入	1,000	2020/2/27			2,541	1,000	0.033		0.053	1.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/20	2020/2/21	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/2/20	2020/2/21	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年2月21日の予定

*1月の全国消費者物価指数(CPI)市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%	*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値 *米国1月の中古住宅販売	*国庫短期証券(890回)入札(3ヶ月、44,400億円、2/25発行) *交付税特別会計借入(10,500億円、3/4借入)
---	------------------------------------	--

◆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