

Central Daily Market Report

2020年2月27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27日		2020年2月28日		2020年3月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400	0				1,000
財政	▲ 5,600		6,500			▲ 37,000
資金過不足	▲ 7,000		6,500			▲ 36,000
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			11,300			
CP等買入		▲ 200		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000			▲ 500		
E T F 買入			100			
国債補充供給	▲ 1,100			1,100		
当増増減		200		17,600		▲ 36,000
当座預金残高	3,999,500		4,017,100		3,981,100	
準備預金残高	3,482,000					
積み終了先	3,481,700		2月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,481,300		積数		5,200	
非準備預金先	517,500		1日平均		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	99.83%	日数	41.38%		

●2020年2月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き調達意欲は旺盛で、立ち上がりは国内勢を中心に▲0.02~▲0.005%のレンジでの出会い。一巡後はオファーが少なく、▲0.01%の出会いが見られた程度であった。ターム物は閑散で、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/28-2/29)は、▲0.09~▲0.07%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、3M物が▲0.1475~▲0.146%、1Y物が▲0.198%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、月初の応当で償還は見られなかったものの、ノンバンク・商社等から大型発行案件も散見され、3,800億円強の発行総額に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2020/2/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.080	0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.081	▲ 0.110	▲ 0.015	21,948.23	▲ 477.96	110.38-39	110.10-11
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.004				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.146	▲ 0.105						
6M							▲ 0.177	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.160						
									日付	2/19	2/20	2/21	2/25	2/26
									日銀当預残	3,984,600	3,979,700	3,986,300	3,998,400	3,999,300
									準備預金残	3,461,400	3,447,000	3,462,000	3,482,400	3,482,400
									マネタリーベース	5,120,200	5,116,600	5,124,600	5,137,100	5,138,300
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.016%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.014%
									コール市場残高	117,726	112,384	132,053	119,700	121,883
									うち無担	97,614	91,902	111,697	100,310	100,119
									うちO/N	67,349	60,387	79,574	67,617	69,611
									うち有担	20,112	20,482	20,356	19,390	21,764

●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/2/28			13,343	4,210	▲0.008		▲0.007	55.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/2/28			12,057	3,408	▲0.012		▲0.011	14.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/2/28			9,028	3,503	▲0.019		▲0.015	28.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/27	2020/2/28	▲ 0.350	1,067	1,067		▲0.350	▲0.350	
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数				
成長基盤強化	本則第39回	2020/3/4	2024/3/4	0	2,178	24				
成長基盤強化	米ドル特別第31期	2020/3/5	2021/3/5		164	24				
成長基盤強化	米ドル特別第27期(借り換え)	2020/3/5	2021/3/5		570	18				
成長基盤強化	米ドル特別第23期(借り換え)	2020/3/5	2021/3/5		1,167	19				
成長基盤強化	米ドル特別第19期(借り換え)	2020/3/5	2021/3/5		3,772	37				

●2020年2月28日の予定

*1月の完全失業率(市場予想:2.2%)	*1月の有効求人倍率(市場予想:1.57倍)	*米国1月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(891回)入札(3ヶ月、47,400億円、3/2発行)
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.2%)	*米国2月のシカゴPM景況感指数		
*1月の商業動態統計速報 *1月の住宅着工統計			
*2月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.6%)			*2年利付国債入札(20,000億円、3/2発行)

◆本資料は信頼できるとさ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