

Central Daily Market Report

2020年2月28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28日		2020年3月2日		2020年3月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		400		0	
財政	8,000		▲ 37,700		▲ 12,000	
資金過不足	8,000		▲ 37,300		▲ 12,000	
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			3,100			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,300					
CP等買入		▲ 900		▲ 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		▲ 500				
E T F 買入	100		200			
国債補充供給	▲ 200	1,100		200		
当預増減	18,900		▲ 34,000		▲ 12,000	
当座預金残高	4,018,400		3,984,400		3,972,400	
準備預金残高	3,494,800					
積み終了先	3,494,400		3月2日以降の残り所要積立額		積数 4,000	
超過準備	3,494,400		1日平均		300	
非準備預金先	523,600					
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	99.87%	日数	51.72%		

●2020年2月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末要因により資金調達を控える動きが見られ、レート低下となった。朝方は国内勢を中心に▲0.04~▲0.005%の出合い。一巡後もレートを切り下げる動きが見られた。ターム物はオファーが少なく、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(3/2-3/3)は、▲0.07~▲0.05%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。アウトライト市場は、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.138~▲0.134%で出合中、平均落札利回▲0.1391%、按分落札利回▲0.1343%となった。3,000億円増発されたものの、債券相場全体が堅調であったことから、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンドリーマーケットにおいては、ショートカバーからか、▲0.200%が少額で出合った。この他に、6M物が▲0.195~▲0.185%、1Y物が▲0.222~▲0.215%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、償還総額は200億円程度と少なかったものの、食品業態等から大口の発行が実施され、発行総額は1,800億円程度に膨らんだ。発行レートに目立った変化は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2020/2/28	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.075	▲ 0.160	▲ 0.050	21,142.96	▲ 805.27	109.62-63	108.83-85
T/N							-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.001	0.000	0.000				-	▲ 0.067						
2W							-	▲ 0.069						
3W			0.005				-	▲ 0.077						
1M			0.002				-	▲ 0.093						
3M			0.002				▲ 0.199	▲ 0.103						
6M							▲ 0.200	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.225	▲ 0.160						
									日付	2/20	2/21	2/25	2/26	2/27
									日銀当預残	3,979,700	3,986,300	3,998,400	3,999,300	3,999,500
									準備預金残	3,447,000	3,462,000	3,482,400	3,482,400	3,482,400
									マネタリーベース	5,116,600	5,124,600	5,137,100	5,138,300	5,139,900
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.014%	▲0.014%
									コール市場残高	112,384	132,053	119,700	121,883	119,208
									うち無担	91,902	111,697	100,310	100,119	98,965
									うちO/N	60,387	79,574	67,617	69,611	68,152
									うち有担	20,482	20,356	19,390	21,764	20,243

●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	891	-	47,400	2020/3/2	2020/6/1	135,219.6	38,650.6	100.0335	▲0.1343%	11.7902%	100.0347	▲0.1391%	8,749.0
2年利付国債	410	0.10%	20,000	2020/3/2	2022/3/1	74,505.0	16,228.0	100.6850	▲0.2410%	93.1202%	100.6850	▲0.2410%	3,771.0

●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	入札総額(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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2020/3/2	2020/3/16		3,070	3,070				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/28	2020/3/2	▲ 0.350	228	228		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年3月2日の予定

*10-12月期の法人企業統計調査季報

*米国1月の建設支出

*米国2月のISM製造業景況指数

◆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お客様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