

# Central Daily Market Report

2019年2月14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	2019年2月14日		2019年2月15日		2019年2月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		0		1,000	
財政	▲ 30,800		84,200		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 31,500		84,200		▲ 7,000	
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						▲ 700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			5,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 500	2,000	
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			500			
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当増増減	▲ 26,600		90,200		▲ 5,700	
当座預金残高	3,756,400		3,846,600		3,840,900	
準備預金残高	3,326,300					
積み終了先	3,326,200				2月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,326,100				積数	
非準備預金先	430,100				1日平均	
1日平均					100	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,135,900	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

## ●2019年2月14日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.075~▲0.020%の出会いが中心となった。積み最終日を明日に控え、調整に目途をつけた先も散見されたこともあり、一巡後は▲0.085~▲0.055%で調整の出会い。ターム物に関してはロール案件中心に出合いが見られた程度であった。

### <レポ市場>

GC T+0(2/14-2/15)は▲0.090~▲0.075%程度、T/N(2/15-2/18)は▲0.125~▲0.105%程度の出会い。T/Nは、新積み期間にかかる取引となったことでレートを切り下げた。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10Y334~353、5Y130~138などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は新積み期にかかり、低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.220%、引け際に6M物が▲0.200%、1Y物が▲0.194%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と若干の発行超であった。一部の卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数はあまり膨らまず落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/2/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総積立	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.082	▲ 0.015	▲ 0.005	21,139.71	▲ 4.77	110.92-94	111.06-08
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.137						
3W							-	▲ 0.139						
1M			▲ 0.041				-	▲ 0.146						
3M							▲ 0.220	▲ 0.163						
6M							▲ 0.200	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.194	▲ 0.164						
									日付	2/6	2/7	2/8	2/12	2/13
									日銀当預残	3,768,700	3,777,000	3,769,300	3,781,600	3,783,000
									準備預金残	3,302,700	3,314,900	3,323,600	3,331,100	3,338,800
									マネタリーベース	4,882,200	4,891,000	4,883,300	4,895,200	4,895,600
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.049%	▲0.051%
									コール市場残高	122,397	111,261	123,083	105,565	116,646
									うち無担	92,872	86,758	95,838	78,572	86,108
									うちO/N	61,217	55,503	58,183	48,747	56,773
									うち有担	29,525	24,503	27,245	26,993	30,538

## ●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	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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/2/15			1,264	500		0.005	0.005	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/2/15			13,339	4,305	▲0.009		▲0.008	53.2
国債買入(変動利付債)	1,000	2019/2/15			1,525	1,001	▲0.050		▲0.158	15.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	56,328	2019/2/14	2019/2/15		120	120		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年2月15日の予定

*12月の石油等消費動態統計	*米国12月の企業在庫(延期) *米国1月の小売売上高(延期) *米国1月の鉱工業生産・設備稼働率 *2月のシンガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(814回)入札(3ヶ月、43,400億円、2/18発行) *10年物価連動国債(4,000億円、2/18発行) *国有林野借入(963億円、2/25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