

Central Daily Market Report

2019年2月20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	2019年2月20日		2019年2月21日		2019年2月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,500		▲ 2,000	
財政	▲ 19,500		▲ 700		4,000	
資金過不足	▲ 20,100		▲ 2,200		2,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 200		
E T F 買入			600			
国債補完供給						
当預増減	▲ 20,200		▲ 1,900		2,000	
当座預金残高	3,833,400		3,831,500		3,833,500	
準備預金残高	3,336,800					
積み終了先	3,328,800		2月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,327,100		積数		16,200	
非準備預金先	496,600		1日平均		700	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					2,820,500	
準備預金進捗率	実績	99.43%	日数	17.86%		

●2019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物は、邦銀を中心に▲0.085~▲0.030%の出合いが中心となった。引き続き地銀業態を中心に資金調達ニーズが底堅く、立ち上がりは▲0.075~▲0.030%で推移し、一巡後に▲0.085~▲0.080%で調整の出合いが散見された。ターム物に関してはショートタームで▲0.040~▲0.020%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(2/20-2/21)は▲0.11~▲0.095%程度、T/N(2/21-2/22)は▲0.11~▲0.10%程度の出合い。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10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61、40Y11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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.208~▲0.2075%、引け際に6M物が▲0.228~▲0.225%、1Y物が▲0.211~▲0.205%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は案件が少なく、償還総額550億円程度に対して、発行総額は200億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/2/20	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.102	▲ 0.040	▲ 0.005	21,431.49	128.84	110.57-59	110.89-90
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.040	▲ 0.012	▲ 0.023				-	▲ 0.124						
3W							-	▲ 0.127						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.139						
3M							▲ 0.208	▲ 0.162						
6M							▲ 0.222	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.164						
									日付	2/13	2/14	2/15	2/18	2/19
									日銀当預残	3,783,000	3,756,400	3,847,100	3,841,400	3,853,600
									準備預金残	3,338,800	3,326,600	3,359,100	3,351,800	3,362,900
									マネタリーベース	4,895,600	4,869,700	4,960,300	4,954,100	4,966,400
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.052%	▲0.057%	▲0.063%	▲0.063%
									コール市場残高	116,646	110,259	91,875	103,747	101,157
									うち無担	86,108	78,820	73,092	80,256	83,490
									うちO/N	56,773	51,985	50,427	53,741	56,725
									うち有担	30,538	31,439	18,783	23,491	17,667

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/2/28	2019/8/30	268,046.0	10,500.19		0.0000%	3.9174%		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)	20,000	2019/2/20	2019/2/21		33	33		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/2/22	2019/2/28	2.9	3	3				

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94回	2019/2/22	2020/2/21	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第33回	2019/2/22	2020/2/21	0

●2019年2月21日の予定

*月例経済報告	*米国12月の耐久財新規受注 *米国1月の中古住宅販売	*流動性供給入札 (6,000億円、2/22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