

Central Daily Market Report

2019年2月25日(月)
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25日 需給速報	2019年2月26日 需給予想	2019年2月27日 当社予想
銀行券	▲ 400	▲ 800	▲ 1,000
財政	4,100	3,000	▲ 4,000
資金過不足	3,700	2,200	▲ 5,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	4,900	▲ 3,300	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	7,200		
CP等買入		▲ 300	▲ 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		700
国債補完供給	▲ 400		400
当預増減	12,400	3,100	▲ 5,000
当座預金残高	3,847,400	3,850,500	3,845,500
準備預金残高	3,371,000		
積み終了先	3,370,500		
超過準備	3,370,400		
非準備預金先	476,400		
2月26日以降の残り所要積立額			
積数 4,300			
1日平均 200			
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	99.85%	日数
			35.71%

●2019年2月25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▲0.086~▲0.030%の出会いが中心となった。引き続き地銀業態を中心に資金調達ニーズが底堅く、一巡後は▲0.080~▲0.035%で調整の出会いが散見された。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.040~▲0.030%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(2/25-2/26)は▲0.085~▲0.065%程度、T/N(2/26-2/27)は▲0.07~▲0.06%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、引け際に3M物が▲0.215%、1Y物が▲0.208%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、機械業態でまとまった調達が見られたものの、発行総額2,100億円に対して償還総額は2,700億円程度と償還超のマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オベがオファー額2,000億円で実施された。結果は平均落札レート0.005%・按分レート▲0.001%となり、前回比(平均落札・按分レート共に▲0.001%)で平均落札レートが上昇、按分レートが横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2019/2/25	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.070	▲ 0.040	0.005	21,528.23	102.72	110.77-78	110.62-63
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.087						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.097						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.212	▲ 0.154						
6M							▲ 0.222	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.207	▲ 0.161						
									日付	2/18	2/19	2/20	2/21	2/22
									日銀当預残	3,841,400	3,853,600	3,833,400	3,830,700	3,835,000
									準備預金残	3,351,800	3,362,900	3,337,100	3,340,300	3,353,200
									マネタリーベース	4,954,100	4,966,400	4,946,700	4,945,600	4,951,100
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.056%	▲0.058%
									コール市場残高	103,747	101,157	107,605	115,430	125,854
									うち無担	80,256	83,490	80,994	87,432	95,105
									うちO/N	53,741	56,725	54,549	60,677	59,120
									うち有担	23,491	17,667	26,611	27,998	30,749

●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	業分率	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
CP等買入	2,000	2019/2/28			6,913	1,973	▲0.001		0.005	31.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,000	2019/2/25	2019/2/26		362	362		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月26日の予定

*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、2/27発行)
*米国12月の住宅着工件数	
*米国1月の新築一戸建て販売件数(延期)	
*米国2月のCB消費者信頼感指数	

◆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