

Central Daily Market Report

2019年2月26日(火)
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26日		2019年2月27日		2019年2月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,000		▲ 1,400	
財政	▲ 1,300		▲ 9,100		6,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 10,100		4,600	
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			2,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 200	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			
E T F 買入	700					
国債補完供給	▲ 100	400		100		
当預増減	▲ 1,300		▲ 7,800		6,600	
当座預金残高	3,846,100		3,838,300		3,844,900	
準備預金残高	3,355,300					
積み終了先	3,354,900				2月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,354,900				積数 3,800	
非準備預金先	490,800				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	99.87%	日数	39.29%		

●2019年2月26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、一巡後は▲0.070~▲0.050%で調整の出合いが散見された。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.030~▲0.020%程度の出合いが見られていた。

<レポ市場>

GC T+0(2/26-2/27)は▲0.06~▲0.05%程度、T/N(2/27-2/28)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。アウトライト市場では、短国買入オペアが2,500億円(前回比▲2,500億円)でオファーされた。応札額が1兆円強と多く、平均落札利回較差+0.025%、按分落札利回較差+0.025%と在庫の積み上がりを反映してか、引き続き弱めの結果となった。マーケットでは、引け際に3M物が▲0.205~▲0.200%、6M物が▲0.222%、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、月末発行にあたり石油・卸売・食料品・不動産業態等で大型案件が相次いだ。発行総額1兆1,000億円程度に対し、償還総額は1兆5,000億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。

●短期金融市場関連指標

2019/2/26	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	▲ 0.052				-	▲ 0.068	▲ 0.030	0.010	21,449.39	▲ 78.84	111.04-06	110.82-84
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.015	▲ 0.033				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.205	▲ 0.151						
6M							▲ 0.220	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.207	▲ 0.160						
									日付	2/19	2/20	2/21	2/22	2/25
									日銀当預残	3,853,600	3,833,400	3,830,700	3,835,000	3,847,400
									準備預金残	3,362,900	3,337,100	3,340,300	3,353,200	3,371,000
									マネタリーベース	4,966,400	4,946,700	4,945,600	4,951,100	4,963,900
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.058%	▲0.056%	▲0.058%	▲0.058%
									コール市場残高	101,157	107,605	115,430	125,854	117,603
									うち無担	83,490	80,994	87,432	95,105	92,838
									うちO/N	56,725	54,549	60,677	59,120	56,743
									うち有担	17,667	26,611	27,998	30,749	24,765

●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)
流動性供給	280	-	5,000	2019/2/27		9,902.0	4,994.0		0.0120%	38.1465%		0.0060%	

●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
国庫短期証券買入	2,500	2019/2/27			11,043	2,501	0.025		0.025	98.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,113	2019/2/26	2019/2/27		113	113		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/2/28	2019/3/7	2.9	0	0				

●2019年2月27日の予定

*片岡日銀審議委員、香川県金融経済懇談会にて講演	*米国1月の耐久財新規受注 *米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫	*交付税特別会計借入(10,500億円、3/8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