

Central Daily Market Report

2020年2月10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	2020年2月10日 需給速報	2020年2月12日 需給予想	2020年2月13日 当社予想
銀行券	300	800	0
財政	▲ 4,400	2,800	▲ 8,000
資金過不足	▲ 4,100	3,600	▲ 8,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	5,800	▲ 7,000	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	11,800	2,300	
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			
E T F 買入	800	500	
国債補完供給	▲ 100	100	100
当預増減	7,200	6,400	▲ 8,000
当座預金残高	3,908,000	3,914,400	3,906,400
準備預金残高	3,399,100		
積み終了先	3,398,900		2月12日以降の残り所要積立額
超過準備	3,398,900		積数
非準備預金先	508,900		1日平均
			700
			200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,241,200
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数
			87.10%

●2020年2月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週末の地合いを引き継いで高水準の出合いとなり、邦銀を中心に▲0.01~▲0.005%の出合いが始まった。一巡後は▲0.015~▲0.01%と横ばい圏で推移した。ターム物は、ロール案件を中心に出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/12-2/13)は、▲0.07~▲0.045%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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、3M物が▲0.146~▲0.144%、6M物が▲0.164~▲0.159%、1Y物が▲0.172~▲0.170%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は製薬、小売業態で大型発行があり、償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は1,300億円程度と発行超となった。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

2020/2/10	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.054	▲ 0.060	▲ 0.020	23,685.98	▲ 142.00	109.62-63	109.80-81
T/N							-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W			0.002				-	▲ 0.060						
2W							-	▲ 0.067						
3W							-	▲ 0.074						
1M							-	▲ 0.083						
3M							▲ 0.145	▲ 0.102						
6M							▲ 0.160	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.172	▲ 0.160						
									日付	2/3	2/4	2/5	2/6	2/7
									日銀当預残	4,005,400	3,924,800	3,911,500	3,911,600	3,900,800
									準備預金残	3,481,800	3,414,500	3,390,900	3,388,800	3,384,000
									マネタリーベース	5,143,800	5,062,300	5,048,300	5,048,700	5,037,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.023%	▲ 0.015%	▲ 0.016%	▲ 0.014%
									コール市場残高	111,701	107,585	108,860	114,687	121,023
									うち無担	91,668	87,874	89,297	95,330	101,779
									うちO/N	63,143	58,249	60,217	66,165	65,744
									うち有担	20,033	19,711	19,563	19,357	19,244

●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	2020/2/12			1,776	500	0.008		0.014	93.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/2/12			7,108	1,208	▲0.010		▲0.009	31.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/2/12			1,754	307	▲0.014		▲0.013	34.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/10	2020/2/12	▲ 0.350	49	49		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年2月11日の予定

*建国記念の日	*英国10-12月期のGDP速報値
---------	-------------------

●2020年2月12日の予定

*1月のマネーストック	*米国1月の財政収支	*10年物物価連動入札(4,000億円、2/13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