

# Central Daily Market Report

2020年2月13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	2020年2月13日 需給速報	2020年2月14日 需給予想	2020年2月17日 当社予想
銀行券	▲ 200	200	1,000
財政	▲ 6,300	73,900	▲ 4,000
資金過不足	▲ 6,500	74,100	▲ 3,000
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	7,500		
国債買入		12,400	
CP等買入		▲ 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	200		
国債補充供給	▲ 100	100	100
当預増減	1,100	86,500	▲ 3,000
当座預金残高	3,912,100	3,998,600	3,995,600
準備預金残高	3,397,700		
積み終了先	3,397,600		
超過準備	3,397,600		
非準備預金先	514,400		
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	99.99%	日数
			93.55%

## ●2020年2月13日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日を直前に控えた取り調整の動きからレート水準は高止まりし、邦銀を中心に▲0.01~▲0.005%の出合いが中心であった。一巡後も▲0.005%の調達希望は残り、引き続き同程度の水準で推移した。ターム物に関しては、新しい積み期スタートのショートターム物で出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(2/14-2/17)は、▲0.115~▲0.085%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、小幅低下。アウトライト市場は、3M物が▲0.140~▲0.136%、6M物が▲0.160~▲0.156%出合いと軟調に推移した。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は電気機器業態で大型発行があり、償還総額2,000億円程度に対して、発行総額は2,500億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

2020/2/13	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.093	▲ 0.035	0.010	23,827.73	▲ 33.48	109.86-88	109.72-73
T/N	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.006				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.011	▲ 0.003	▲ 0.004				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.140	▲ 0.103						
6M							▲ 0.160	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.159						
									日付	2/5	2/6	2/7	2/10	2/12
									日銀当預残	3,911,500	3,911,600	3,900,800	3,908,000	3,911,000
									準備預金残	3,390,900	3,388,800	3,384,000	3,399,800	3,404,500
									マネタリーベース	5,048,300	5,048,700	5,037,400	5,044,300	5,046,400
									無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.010%	▲0.008%
									コール市場残高	108,860	114,687	121,023	109,495	103,448
									うち無担	89,297	95,330	101,779	90,381	84,793
									うちO/N	60,217	66,165	65,744	53,896	57,878
									うち有担	19,563	19,357	19,244	19,114	18,655

## ●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年超3年以下)	4,200	2020/2/14			17,951	4,204	0.000		0.003	48.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/2/14			11,130	3,404	0.005		0.006	95.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/2/14			12,341	3,501	0.009		0.010	97.1
国債買入(変動利付債)	1,000	2020/2/14			3,097	1,006	▲0.260		▲0.262	37.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/13	2020/2/14	-0.35	110	110		▲0.350	▲0.350	

## ●2020年2月14日の予定

*両宮日銀副総裁、東京証券取引所主催セミナーにおいて講演	*米国12月の企業在庫	*国庫短期証券(888回)入札(3ヶ月、44,400億円、2/17発行)
*12月の第3次産業活動指数	*米国1月の小売売上高	*流動性供給入札(6,000億円、2/17発行)
	*米国1月の鉱工業生産・設備稼働率	*国有林野借入(962億円、2/25借入)
	*米国2月のミシガン大消費者信頼感指数速報	
	*ユーロ圏10-12月期のGDP2次速報	

◆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