

Central Daily Market Report

2020年2月21日(金)
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21日		2020年2月25日		2020年2月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 100		▲ 1,000	
財政	5,400		▲ 800		2,000	
資金過不足	4,100		▲ 900		1,000	
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			7,000	▲ 5,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,500			
CP等買入	3,500	▲ 800		▲ 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		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	6,600		11,600		1,000	
当座預金残高	3,986,300		3,997,900		3,998,900	
準備預金残高	3,460,800					
積み終了先	3,459,000		2月25日以降の残り所要積立額		積数 7,200	
超過準備	3,456,800				1日平均 400	
非準備預金先	525,500					
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,026,800	
準備預金進捗率	実績	99.76%	日数	31.03%		

●2020年2月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き資金調達意欲が強いなか、朝方は国内勢を中心に▲0.035~▲0.005%の出会い。週末要因も重なり、一部業態では取り上がる動きも見られた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(2/25-2/26)は、▲0.08~▲0.05%程度での出会い。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、上昇。アウトライト市場は、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.135~▲0.133%で出合う中、平均落札利回▲0.1285%、按分落札利回▲0.1216%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、引け際に▲0.128%で出合った。この他に、6M物が▲0.163~▲0.162%、1Y物が▲0.160%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼業態1社でまとまった額の調達が行われたものの、案件数は膨らまず、発行総額は1,300億円程度と償還総額の1,800億円程度を下回った。発行レートについては、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/2/21	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	▲ 0.016				-	▲ 0.078	▲ 0.065	▲ 0.020	23,386.74	▲ 92.41	111.96-98	111.73-74
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.002	▲ 0.004				-	▲ 0.078						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.083						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.128	▲ 0.102						
6M							▲ 0.164	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.158						
									日付	2/14	2/17	2/18	2/19	2/20
									日銀当預残	3,998,800	4,000,200	4,001,200	3,984,600	3,979,700
									準備預金残	3,478,600	3,472,900	3,475,600	3,461,400	3,447,000
									マネタリーベース	5,134,200	5,135,100	5,136,100	5,120,200	5,116,600
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.025%	▲0.018%	▲0.017%	▲0.016%
									コール市場残高	103,638	110,990	113,283	117,726	112,384
									うち無担	85,069	92,953	94,548	97,614	91,902
									うちO/N	55,204	63,993	64,158	67,349	60,387
									うち有担	18,569	18,037	18,735	20,112	20,482

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	890	-	44,400	2020/2/25	2020/5/25	119,555.5	36,026.4	100.0300	▲0.1216%	4.5174%	100.0317	▲0.1285%	8,373.0	
交付税特会	-	-	10,500	2020/3/4	2020/9/2	254,418.0	10,490.20		0.0000%	4.1233%		0.0000%		10.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2020/2/25	2020/3/16		7,021	7,021				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/2/25			17,029	4,203	▲0.008		▲0.006	56.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/2/25			10,283	3,401	▲0.011		▲0.008	72.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/2/25			8,177	3,502	▲0.018		▲0.014	37.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/21	2020/2/25	-0.35	59	59		▲0.350	▲0.350	

●2020年2月25日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況	*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*1月の企業向けサービス価格指数	*米国2月の米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