

# Central Daily Market Report

2020年2月25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	2020年2月25日		2020年2月26日		2020年2月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		▲ 2,000	
財政	100		▲ 400		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 300		▲ 800		▲ 6,000	
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		2,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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			1,000	
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	12,100		1,600		▲ 5,000	
当座預金残高	3,998,400		4,000,000		3,995,000	
準備預金残高	3,481,700					
積み終了先	3,480,900					
超過準備	3,480,900				2月26日以降の残り所要積立額 積数 6,400	
非準備預金先	516,700				1日平均 300	
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	99.79%	日数	34.48%		

## ●2020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、週末要因が剥落したものの、調達意欲は旺盛で、朝方は地銀・信託・証券業態を中心に▲0.025~▲0.008%の出合い。一巡後は閑散で散発的な出合いが見られた程度であった。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(2/26-2/27)は、▲0.105~▲0.08%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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.133~▲0.131%、6M物が▲0.176~▲0.169%、1Y物が▲0.189~▲0.180%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、1,500億円弱の償還に対して、1,500億円強の発行が見られ、若干の発行超となり、電力業態等からは大口の発行が見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/2/25	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.085	▲ 0.105	▲ 0.040	22,605.41	▲ 781.33	110.84-85	110.71-72
T/N	▲ 0.025	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.002	▲ 0.011				-	▲ 0.080						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.085						
1M			0.005				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.133	▲ 0.103						
6M							▲ 0.170	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.181	▲ 0.158						
									日付	2/17	2/18	2/19	2/20	2/21
									日銀当預残	4,000,200	4,001,200	3,984,600	3,979,700	3,986,300
									準備預金残	3,472,900	3,475,600	3,461,400	3,447,000	3,462,000
									マネタリーベース	5,135,100	5,136,100	5,120,200	5,116,600	5,124,600
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.018%	▲0.017%	▲0.016%	▲0.016%
									コール市場残高	110,990	113,283	117,726	112,384	132,053
									うち無担	92,953	94,548	97,614	91,902	111,697
									うちO/N	63,993	64,158	67,349	60,387	79,574
									うち有担	18,037	18,735	20,112	20,482	20,356

## ●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	2020/2/26			1,921	501	0.006		0.012	35.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/2/26			3,511	1,204	▲0.017		▲0.013	88.5
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/2/26			1,314	306	▲0.007		▲0.007	90.1
国債買入(物価連動債)	300	2020/2/26			1,588	301	0.000		▲0.036	27.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/2/25	2020/2/26	▲0.350	115	115		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/2/27	2020/3/5	2.080	1	1				

## ●2020年2月26日の予定

*米国1月の新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札(5,000億円、2/27発行)
	*交付税特別会計借入(10,500億円、3/6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