

●資金需給

単位：億円	2019年1月4日 需給速報	2019年1月7日 需給予想	2019年1月8日 当社予想
銀行券	6,000	4,200	5,000
財政	▲ 22,000	▲ 3,100	▲ 28,000
資金過不足	▲ 16,000	1,100	▲ 23,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,900
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		4,700	
CP等買入		▲ 700	
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	
国債補完供給	▲ 100	700	100
当預増減	▲ 15,400	5,400	▲ 24,900
当座預金残高	3,876,100	3,881,500	3,856,600
準備預金残高	3,375,700		
積み終了先	3,375,500	1月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,375,400	積数	1,400
非準備預金先	500,400	1日平均	200
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額			3,118,200
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数
			70.97%

●2019年1月4日の市場動向

＜インターバンク市場＞
本日の無担O/N物は、四半期末越えの取引となった前営業日と比べ、調達サイドのネーム・ボリュームともに増加したものの、依然として全体の調達量は限定的でオファーサイドの出し残りも見られた。出合いのレンジは▲0.086～▲0.02%とワイドであるが、▲0.086%の出合いが大部分を占めた。ターム物は四半期末でエンドを迎えた先から取引を再開する動きが見られ、ショートタームを中心に引き合いが見られた。

＜レポ市場＞
GC T+0(1/4-1/7)は▲0.095～▲0.085%程度、T/N(1/7-1/8)は▲0.090～▲0.080%程度で出合いが見られた。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10Y335～352や、5Y130～137、20Y164～166、30Y57～60などカレント近辺の銘柄にビッドが目立った。

＜短国市場＞
現先レート(T/N)は小幅上昇。アウトライト市場は、世界的なリスクオフの流れで利付債が強含みとなる中、3M物が▲0.180～▲0.165%、1Y物が▲0.180%出合いと堅調に推移した。

＜CP市場＞
現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額400億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超であった。一部の卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数少なく閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/1/4	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.094	▲ 0.040	▲ 0.036	19,561.96	▲ 452.81	107.84-86	107.84-86
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.047				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.112						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.045	0.200	0.004				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.190	▲ 0.152						
6M							▲ 0.190	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.159						
									日付	12/21	12/25	12/26	12/27	12/28
									日銀当預残	3,896,200	3,898,900	3,901,600	3,891,700	3,891,500
									準備預金残	3,371,400	3,392,300	3,397,900	3,386,100	3,377,700
									マネタリーベース	5,033,800	5,039,700	5,046,100	5,041,200	5,043,500
									無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.070%	▲0.055%
									コール市場残高	88,547	93,383	92,482	87,640	64,993
									うち無担	76,152	72,036	71,070	72,009	39,941
									うちO/N	39,807	36,021	34,855	36,714	18,986
									うち有担	12,395	21,347	21,412	15,631	25,052

●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5年超10年以下)	4,300	2019/1/7			10,230	4,310	▲0.048		▲0.045	53.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	35,712	2019/1/4	2019/1/7		112	112		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月7日の予定

12月実績/1月見込み財政資金対民間収支 12月のマネタリーベース	米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫 米国12月のISM非製造業景況指数
--------------------------------------	--

◆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論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