

Central Daily Market Report

2019年1月7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 | 2019年1月7日 | | 2019年1月8日 | | 2019年1月9日 | |
|------------------------|-----------|-------|-----------|---------|----------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 4,600 | | 4,600 | | 3,000 | |
| 財政 | ▲ 2,800 | | ▲ 29,200 | | ▲ 18,000 | |
| 資金過不足 | 1,800 | | ▲ 24,600 | | ▲ 15,000 | |
| 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 | | | 1,800 | ▲ 1,900 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | 4,700 | | 10,400 | | | |
| 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 | ▲ 200 | 100 | | 200 | | |
| 当増増減 | 5,900 | | ▲ 14,100 | | ▲ 15,000 | |
| 当座預金残高 | 3,882,000 | | 3,867,900 | | 3,852,900 | |
| 準備預金残高 | 3,397,800 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,397,500 | | | | 1月8日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,397,500 | | | | 積数 | |
| 非準備預金先 | 484,200 | | | | 1日平均 | |
| | | | | | 100 | |
| 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 | |
| | | | | | 74.19% | |

●2019年1月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、大手行の一部から調達が増加したことにより出し残りが減少したものの、引き続き全体の調達量は限定的であり、レート水準に大きな変化は見られなかった。レートは▲0.086~▲0.085%の出合いが大部分を占めた。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(1/7-1/8)は▲0.090~▲0.080%程度、T/N(1/8-1/9)は▲0.085~▲0.075%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)は上昇。アウトライト市場は、今週の3回の入札を控えて様子見閑散であった。出合いは、引け際に3M物が▲0.19%で少額出合った程度だった。

<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1,600億円程度に対して、発行総額は2,600億円程度と発行超であった。一部の卸売・小売業態において大型案件が見られたものの、案件数はあまり膨らまず落ち着い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

| 2019/1/7 | 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 | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.069 | | | | - | ▲ 0.087 | ▲ 0.020 | 0.020 | 20,038.97 | 477.01 | 108.54-56 | 108.18-20 |
| T/N | | | ▲ 0.020 | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.065 | ▲ 0.005 | ▲ 0.051 | | | | - | ▲ 0.095 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.050 | ▲ 0.010 | ▲ 0.027 | | | | - | ▲ 0.111 | | | | | | |
| 3W | ▲ 0.050 | 0.000 | ▲ 0.029 | | | | - | ▲ 0.115 | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.005 | | | | - | ▲ 0.126 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.190 | ▲ 0.152 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.190 | ▲ 0.158 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.180 | ▲ 0.158 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 12/25 | 12/26 | 12/27 | 12/28 | 1/4 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 3,898,900 | 3,901,600 | 3,891,700 | 3,891,500 | 3,876,100 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,392,300 | 3,397,900 | 3,386,100 | 3,377,700 | 3,375,800 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 5,039,700 | 5,046,100 | 5,041,200 | 5,043,500 | 5,022,200 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.070% | ▲ 0.070% | ▲ 0.070% | ▲ 0.055% | ▲ 0.070% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 93,383 | 92,482 | 87,640 | 64,993 | 104,081 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 72,036 | 71,070 | 72,009 | 39,941 | 69,957 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 36,021 | 34,855 | 36,714 | 18,986 | 40,732 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 21,347 | 21,412 | 15,631 | 25,052 | 34,124 |

●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 |
|---------------------------|----------------|----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 共通担保資金供給(全店)<固定金利方式> | 8,000 | 2019/1/8 | 2019/1/21 | | 1,796 | 1,796 | | | | |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下) | 3,500 | 2019/1/8 | | | 12,135 | 3,504 | 0.009 | | 0.009 | 93.3 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 4,000 | 2019/1/8 | | | 9,872 | 4,001 | 0.009 | | 0.011 | 30.1 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 2,000 | 2019/1/8 | | | 7,159 | 2,013 | 0.019 | | 0.019 | 97.8 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 500 | 2019/1/8 | | | 1,778 | 504 | 0.020 | | 0.020 | 70.6 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 48,266 | 2019/1/7 | 2019/1/8 | | 204 | 204 | | ▲ 0.600 | ▲ 0.600 | |

●2019年1月8日の予定

| | | |
|-------------------|----------------|-------------------------------------|
| *12月の消費動向調査 | *米国11月の貿易収支 | *国庫短期証券(805回)入札(3ヶ月、43,400億円、1/9発行) |
| *1月の日銀当座預金増減要因見込み | *米国11月の消費者信用残高 | *10年利付国債入札(22,000億円、1/9発行) |
| | | *交付税特別会計借入(10,500億円、1/18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