

Central Daily Market Report

2019年1月8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	2019年1月8日		2019年1月9日		2019年1月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	4,600		4,000		3,000	
財政	▲ 28,200		▲ 18,700		2,000	
資金過不足	▲ 23,600		▲ 14,700		5,000	
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	10,400					
CP等買入				▲ 400		
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			700			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 13,200		▲ 14,300		5,000	
当座預金残高	3,868,800		3,854,500		3,859,500	
準備預金残高	3,406,900					
積み終了先	3,406,700				1月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,406,700				積数	900
非準備預金先	461,900				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	99.97%	日数	77.42%		

●2019年1月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日に比べ調達はやや増加したことを受け、オファーサイドは昨日に比べ若干高めのレートを提示し、ビットサイドが取り応じる形で始まった。出合いのレンジは▲0.086~▲0.02%で、大手行は▲0.086~▲0.075%の出合いが中心と、昨日比でレートは上昇した。ターム物は引き続きショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(1/8-1/9)は▲0.080~▲0.075%程度、T/N(1/9-1/10)は▲0.080~▲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、40Y11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)は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。今週は本日の入札を含めて計3回の入札が予定されており、足元ファンディングレートも上昇していることから、慎重な応札姿勢も予想された。WI取引において▲0.15%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1529%、按分落札利回▲0.1455%と前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.150~▲0.145%で小動きとなった。

<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1,500億円程度に対して、発行総額は5,000億円程度と発行超であった。5・10日発行となり卸売・鉄鋼等の業態において大型案件が複数見られ、案件数が膨らんだため活況な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

2019/1/8	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.083	0.010	0.030	20,204.04	165.07	108.63-64	108.96-98
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.091						
2W			0.000				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.118						
1M			0.000				-	▲ 0.128						
3M							▲ 0.150	▲ 0.151						
6M							▲ 0.190	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.158						
									日付	12/26	12/27	12/28	1/4	1/7
									日銀当預残	3,901,600	3,891,700	3,891,500	3,876,100	3,882,000
									準備預金残	3,397,900	3,386,100	3,377,700	3,375,800	3,397,800
									マネタリーベース	5,046,100	5,041,200	5,043,500	5,022,200	5,023,600
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.070%	▲0.055%	▲0.070%	▲0.068%
									コール市場残高	92,482	87,640	64,993	104,081	110,792
									うち無担	71,070	72,009	39,941	69,957	80,957
									うちO/N	34,855	36,714	18,986	40,732	49,562
									うち有担	21,412	15,631	25,052	34,124	29,835

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	805	-	43,400	2019/1/9	2019/4/8	140,889.6	35,472.6	100.0355	▲0.1455%	99.8298%	100.0373	▲0.1529%	7,927.0
10年利付国債	353	0.10%	22,000	2019/1/9	2028/12/20	71,509.0	17,695.0	100.8300	0.0160%	39.9871%	100.8400	0.0150%	4,283.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/1/18	2019/7/19	255,427.0	10,500.17		0.0000%	4.1109%		0.0000%	

●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	入札総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	16,139	2019/1/8	2019/1/9		41	41		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/1/10	2019/1/17	2.9	0	0				

●2019年1月9日の予定

*11月の毎月勤労統計調査速報

*国庫短期証券(806回)入札
(6ヶ月、23,000億円、1/10発行)

◆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お客様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