

Central Daily Market Report

2019年1月9日(水)

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9日		2019年1月10日		2019年1月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,800		2,800		3,000	
財政	▲19,500		1,200		▲6,000	
資金過不足	▲15,700		4,000		▲3,000	
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						
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		▲400		▲100		
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		600			
国債補完供給		100				
当預増減	▲15,300		9,200		▲3,000	
当座預金残高	3,853,500		3,862,700		3,859,700	
準備預金残高	3,401,200					
積み終了先	3,400,900				1月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,400,900				積数	700
非準備預金先	452,300				1日平均	100
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						3,123,800
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	80.65%		

●2019年1月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.085~▲0.04%の調達希望で始まった。各業態の調達需要は堅調で、立ち上がりから▲0.08~▲0.075%のオファーが積極的にテイクンされ、出合いレートは昨日よりも上昇した。一巡後は▲0.085~▲0.05%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(1/9-1/10)は▲0.080~▲0.075%程度、T/N(1/10-1/11)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、6M物の入札が実施された。足元ファンディングレートの上昇等から慎重姿勢が強まり、WI取引において▲0.137~▲0.135%と小甘い出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1410%、按分落札利回▲0.1410%と水準感からの買いもあつてか落ち着いた結果となった。セカンダリーでは、▲0.175~▲0.155%での出合いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.155~▲0.152%で出合った。

<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2,500億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と若干の償還超であった。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

2019/1/9	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	▲0.062				-	▲0.082	0.025	0.015	20,427.06	223.02	108.75-76	108.91-92
T/N			▲0.020				-	▲0.081						
S/N							-	-						
1W	▲0.020	0.000	▲0.011				-	▲0.094						
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.020				-	▲0.118						
3W							-	▲0.122						
1M			▲0.045				-	▲0.130						
3M			0.004				▲0.155	▲0.150						
6M							▲0.174	▲0.156						
1Y							▲0.175	▲0.157						
									日付	12/27	12/28	1/4	1/7	1/8
									日銀当預残	3,891,700	3,891,500	3,876,100	3,882,000	3,868,800
									準備預金残	3,386,100	3,377,700	3,375,800	3,397,800	3,406,900
									マネタリーベース	5,041,200	5,043,500	5,022,200	5,023,600	5,005,800
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.055%	▲0.070%	▲0.068%	▲0.066%
									コール市場残高	87,640	64,993	104,081	110,792	112,624
									うち無担	72,009	39,941	69,957	80,957	79,937
									うちO/N	36,714	18,986	40,732	49,562	47,117
									うち有担	15,631	25,052	34,124	29,835	32,687

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	806	-	23,000	2019/1/10	2019/7/10	124,042.0	18,694.8	100.0700	▲0.1410%	99.8317%	100.0700	▲0.1410%	4,305.0

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/1/10			14,153	4,313	0.013		0.013	52.7
国債買入(物価連動債)	250	2019/1/10			1,380	252	▲0.100		▲0.106	93.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	28,530	2019/1/9	2019/1/10		4	4		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月10日の予定

- *日銀支店長会議 さくらレポート (＝地域経済報告)
- *11月の景気動向指数速報
- *12月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国11月の卸売売上高
- *30年利付国債入札 (7,000億円、1/11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