

Central Daily Market Report

2019年1月10日(木)
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10日		2019年1月11日		2019年1月15日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	2,700		2,300		3,000		
財政	3,400		▲ 9,000		▲ 12,000		
資金過不足	6,100		▲ 6,700		▲ 9,000		
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						▲ 5,500	
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		▲ 100		▲ 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	600		200				
国債補完供給	▲ 2,300			2,300			
当預増減	9,000		▲ 4,300		▲ 14,500		
当座預金残高	3,862,500		3,858,200		3,843,700		
準備預金残高	3,398,600						
積み終了先	3,398,500				1月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,398,400				積数		400
非準備預金先	463,900				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		99.99%		日数		83.87%

●短期金融市場関連指標

2019/1/10	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	▲ 0.058				-	▲ 0.084	0.020	▲ 0.005	20,163.80	▲ 263.26	108.18-19	107.92-93
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.119						
3W							-	▲ 0.127						
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.158	▲ 0.150						
6M							▲ 0.175	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.157						
									日付	12/28	1/4	1/7	1/8	1/9
									日銀当預残	3,891,500	3,876,100	3,882,000	3,868,800	3,853,500
									準備預金残	3,377,700	3,375,800	3,397,800	3,406,900	3,401,200
									マネタリーベース	5,043,500	5,022,200	5,023,600	5,005,800	4,986,500
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.070%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%
									コール市場残高	64,993	104,081	110,792	112,624	114,480
									うち無担	39,941	69,957	80,957	79,937	84,426
									うちO/N	18,986	40,732	49,562	47,117	51,161
									うち有担	25,052	34,124	29,835	32,687	30,054

●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)
30年利付国債	61	0.70%	7,000	2019/1/11	2048/12/20	22,697.0	5,636.00	99.6000	0.7160%	87.3552%	99.6200	0.7150%	1,355.0

●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
CP等買入	2,500	2019/1/16			7,887	2,460	▲ 0.001		0.003	54.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	185,801	2019/1/10	2019/1/11		1,764	1,764		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	19,867	2019/1/10	2019/1/11		492	492		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2019年1月11日の予定

*11月の全世帯家計調査 (市場調査：消費支出、前年比▲0.1%)	*米国12月の財政収支 *米国12月の消費者物価指数	*国庫短期証券(807回)入札 (3ヶ月、43,400億円、1/15発行) *エネルギー対策借入 (5,000億円、1/22借入)
--------------------------------------	-------------------------------	--

◆本資料は信頼できるとさ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。

◆本資料は何ら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