

Central Daily Market Report

2019年1月11日(金)
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11日		2019年1月15日		2019年1月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,500		2,500		3,000	
財政	▲ 5,300		▲ 7,900		1,000	
資金過不足	▲ 2,800		▲ 5,400		4,000	
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			5,100	▲ 5,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 300	2,500	
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		700			
国債補完供給	▲ 100	2,300		100		
当預増減	▲ 500		▲ 5,300		6,500	
当座預金残高	3,862,000		3,856,700		3,863,200	
準備預金残高	3,382,900					
積み終了先	3,382,800		1月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,382,800		積数		100	
非準備預金先	479,100		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	100.00%	日数	96.77%		

●2019年1月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.08~▲0.03%の調達希望で始まった。三連休前の取引にあたることや、積み最終日を目前に控えていることなど複数の要因が重なったため、地銀業態などからは積極的な調達が見られた一方、その他の業態では調達量を抑える参加者もあり、各参加者の調達姿勢にばらつきが見られる展開となった。そのため、出会いレンジは上下方向に広がる形となり、立ち上がりは▲0.08~▲0.02%近辺の出会いが中心となった。一巡後はレートを切り下げ▲0.086~▲0.08%の出会いを中心に推移した。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(1/11-1/15)は▲0.100~▲0.095%程度、T/N(1/15-1/16)は▲0.120~▲0.090%程度で出会いが見られた。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。アウトライ市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.150~▲0.145%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1504%、按分落札利回▲0.1459%と事前予想通りの落ち着いた結果となった。セカンダリーでは、▲0.165%での出会いと強含みで推移した。この他には、引け際に6M物が▲0.180%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。CP発行市場は発行総額1,000億円程度であった。一部の卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数は少なく閑散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

2019/1/11	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	▲ 0.058				-	▲ 0.099	0.010	▲ 0.010	20,359.70	195.90	108.28-29	108.33-34
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.124						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.032				-	▲ 0.133						
3W							-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.163	▲ 0.151						
6M							▲ 0.178	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.157						
									日付	1/4	1/7	1/8	1/9	1/10
									日銀当預残	3,876,100	3,882,000	3,868,800	3,853,500	3,862,500
									準備預金残	3,375,800	3,397,800	3,406,900	3,401,200	3,396,300
									マネタリーベース	5,022,200	5,023,600	5,005,800	4,986,500	4,992,900
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%	▲0.058%
									コール市場残高	104,081	110,792	112,624	114,480	108,152
									うち無担	69,957	80,957	79,937	84,426	83,350
									うちO/N	40,732	49,562	47,117	51,161	51,165
									うち有担	34,124	29,835	32,687	30,054	24,802

●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	807	-	43,400	2019/1/15	2019/4/15	151,782.0	35,146.3	100.0360	▲0.1459%	96.5517%	100.0371	▲0.1504%	8,253.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2019/1/22	2020/1/20	87,537.0	4,999.94		0.0000%	5.7119%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2019/1/15	2019/1/28		5,115	5,115				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	78,635	2019/1/11	2019/1/15		36	36		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,972	2019/1/11	2019/1/15		20	20		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月15日の予定

*11月の特定サービス産業動態統計速報 *米国12月の生産者物価指数
*12月のマネーストック

◆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