

Central Daily Market Report

2019年1月15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15日 需給速報	2019年1月16日 需給予想	2019年1月17日 当社予想
銀行券	2,500	2,600	2,000
財政	▲1,800	▲600	▲19,000
資金過不足	700	2,000	▲17,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		10,400	
CP等買入		▲300	▲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		100
国債補完供給	▲1,000	100	1,000
当預増減	▲200	15,900	▲17,000
当座預金残高	3,861,800	3,877,700	3,860,700
準備預金残高	3,373,600		
積み終了先	3,373,600		
超過準備	3,373,500		
非準備預金先	488,200		
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,140,800
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数
			0.00%

●2019年1月15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~▲0.02%の調達希望で始まった。積み最終日を迎え、調達ニーズは参加者によって強弱が見られ、出会いのレンジは前日比横ばいの▲0.08~▲0.015%となった。一巡後は出し取り共に大きな調整は無く取引を終えた。ターム物は、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(1/15-1/16)は▲0.100~▲0.090%程度、T/N(1/16-1/17)は▲0.130~▲0.110%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10Y335~353や、5Y130~137、20Y164~166、30Y57~61、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。アウトライト市場は、3M物で▲0.170%でのまとまった出会いが見られた。この他に、引け際に3M物が▲0.171~▲0.169%、6M物が▲0.180~▲0.175%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行総額は1,100億円程度と償還総額の200億円程度を上回った。12月末日に18兆円台まで減少した市場発行残高は、1月4日には20兆円台に回復し、直近では20兆4,000億円程度と高い水準で推移している。発行レートは概ね横ばい圏で推移しているものの、市場発行残高増を受けて、一部銘柄においては若干上昇する動きも見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/1/15	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	▲0.062				-	▲0.096	0.010	0.000	20,555.29	195.59	108.23-25	108.64-66
T/N			▲0.020				-	▲0.123						
S/N							-	-						
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.036				-	▲0.127						
2W	▲0.045	▲0.035	▲0.040				-	▲0.132						
3W							-	▲0.138						
1M	▲0.016	0.000	▲0.012				-	▲0.143						
3M							▲0.169	▲0.152						
6M							▲0.179	▲0.158						
1Y							▲0.175	▲0.158						
									日付	1/7	1/8	1/9	1/10	1/11
									日銀当預残	3,882,000	3,868,800	3,853,500	3,862,500	3,862,000
									準備預金残	3,397,800	3,406,900	3,401,200	3,396,300	3,383,100
									マネタリーベース	5,023,600	5,005,800	4,986,500	4,992,900	4,989,900
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%	▲0.058%	▲0.058%
									コール市場残高	110,792	112,624	114,480	108,152	104,196
									うち無担	80,957	79,937	84,426	83,350	78,228
									うちO/N	49,562	47,117	51,161	51,165	47,123
									うち有担	29,835	32,687	30,054	24,802	25,968

●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	応募総額(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1年超3年以下)	3,500	2019/1/16			8,013	3,505	0.002		0.003	86.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/1/16			12,052	4,006	0.001		0.002	15.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/1/16			4,879	2,011	0.003		0.004	89.4
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/1/16			1,403	506	0.006		0.007	44.6
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	206,383	2019/1/15	2019/1/16		968	968		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/1/17	2019/1/25	2.9						

●2019年1月16日の予定

*11月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.5%)	*米国11月の企業在庫 *米国12月の小売売上高 *英国12月の消費者物価指数	*5年利付国債入札 (20,000億円、1/17発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、1/24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