

# Central Daily Market Report

2019年1月16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16日		2019年1月17日		2019年1月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,700		1,300		1,000	
財政	▲ 600		▲ 18,800		▲ 1,000	
資金過不足	2,100		▲ 17,500		0	
<b>金融調節</b>	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						
国庫短期証券買入			5,000			
国債買入	10,400					
CP等買入	2,500 ▲ 100			▲ 200		
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	100					
国債補完供給		1,000				
当預増減	16,000		▲ 12,700		0	
当座預金残高	3,877,800		3,865,100		3,865,100	
準備預金残高	3,373,500					
積み終了先	1,634,100		1月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	891,300		積数		658,700	
非準備預金先	504,300		1日平均		22,000	
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	79.03%	日数	3.23%		

## ●2019年1月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.086~▲0.03%での調達で始まった。積み初日の取引ということもあり、取り急ぎ動きは見られず、一巡後も▲0.08%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.04%近辺での出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(1/16-1/17)は▲0.200~▲0.100%程度、T/N(1/17-1/18)は▲0.150~▲0.105%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10Y335~353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、低水準で推移した。アウトライト市場では、短国買入オベが市場予想を上回る5,000億円(前回比+4,000億円)でオファーされた。オベ通告後に3M物で▲0.177~▲0.175%での出合いが見られた。結果は、平均落札利回較差▲0.003%、按分落札利回較差▲0.006%と堅調であった。その後のマーケットでも、3M物が▲0.180~▲0.175%、6M物が▲0.180%出合いと強含みで推移した。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼業態で大口の発行がみられ、償還総額500億円程度に対し、発行総額は1,800億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは引き続き0%近辺の狭いレンジで推移している。本日はCP等買入オベが2,500億円オファーされた。前回のオベから2営業日しか空いていないこともあり、結果は平均落札レート▲0.001%、按分落札レート▲0.002%と、前回比(平均0.003%、按分▲0.001%)で平均、按分ともに低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/1/16	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	▲ 0.068				-	▲ 0.182	0.002	▲ 0.008	20,442.75	▲ 112.54	108.65-67	108.61-62
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.147						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.047	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.147						
2W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.031				-	▲ 0.148						
3W	0.000	0.035	0.018				-	▲ 0.151						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.180	▲ 0.158						
6M							▲ 0.180	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.159						
									日付	1/8	1/9	1/10	1/11	1/15
									日銀当預残	3,868,800	3,853,500	3,862,500	3,862,000	3,861,800
									準備預金残	3,406,900	3,401,200	3,396,300	3,383,100	3,373,600
									マネタリーベース	5,005,800	4,986,500	4,992,900	4,989,900	4,987,300
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.062%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.062%
									コール市場残高	112,624	114,480	108,152	104,196	108,711
									うち無担	79,937	84,426	83,350	78,228	83,384
									うちO/N	47,117	51,161	51,165	47,123	53,894
									うち有担	32,687	30,054	24,802	25,968	25,327

## ●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)
5年利付国債	138	0.10%	20,000	2019/1/17	2023/12/20	83,443.0	16,215.00	101.2100	▲0.1440%	85.4629%	101.2100	▲0.1440%	3,777.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/1/24	2019/7/25	267,948.0	10,500.18		0.0000%	3.9188%		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	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
国庫短期証券買入	5,000	2019/1/17			14,639	5,002	▲0.006		▲0.003	89.9
CP等買入	2,500	2019/1/21			6,967	2,485	▲0.002		▲0.001	32.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	3,537	2019/1/16	2019/1/17		19	19		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/1/16	2019/1/17		4	4		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第93回	2019/1/18	2020/1/17	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第32回	2019/1/18	2020/1/17	0

## ●2019年1月17日の予定

*米国12月の住宅着工件数	*国庫短期証券(808回)入札
*ユーロ圏12月の消費者物価指数改定値	(1年、21,000億円、1/21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