Central Daily Market Report

2019年1月18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18日 需給速報		2019年1月21日 需給予想		2019年1月22日 当社予想	
銀行券	1,500		1,700		1,000	
財政	▲ 1,900		▲ 20,000		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 400		▲ 18,300		0	
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			1,700	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,900					
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	300					
国債補完供給		400				
当預増減	5,000		▲ 16,200		0	

当座預金残高	3,869,600	3,853,400	3,853,400
準備預金残高	3,366,900		
積み終了先	3,357,700		
超過準備	3,332,000		
非準備預金先	502,700		

1月21日以降の残り所要積立額	
積数	29,200
1日平均	1,100

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	99.07%	日数 16.13%

●2019年1月18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。週末を迎えたが、調達ニーズは引き続き弱く、一巡後は▲0.08%近辺での出合いが数件見られる程度で今週の取引を終えた。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。共通担保資金供給オペは8,000億円(1/21～2/4)オファーされ、応札額1,706億円(期落ち分1,796億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T+0(1/18-1/21)は▲0.150～▲0.105%程度での出合い、T/N(1/21-1/22)は▲0.140～▲0.110%程度での出合い。短国発行要因からレート水準を切り上げた。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、5Y130～138、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.178%から▲0.190%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.1880%、按分落札利回▲0.1804%と、前回債からレートが低下する強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物で▲0.210～▲0.195%での出合いが見られるなど、全般的に強含みの展開となった。この他に、1Y物が▲0.195%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は案件少なく閑散だった。発行総額は350億円程度と償還総額と同程度だった。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/1/18	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.067				－	▲ 0.146
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.144
S/N			0.001				－	－
1W	▲ 0.050	▲ 0.017	▲ 0.039				－	▲ 0.148
2W	▲ 0.034	0.000	▲ 0.021				－	▲ 0.150
3W							－	▲ 0.151
1M							－	▲ 0.152
3M							▲ 0.200	▲ 0.158
6M							▲ 0.200	▲ 0.159
1Y							▲ 0.195	▲ 0.158

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.006	0.003	20,666.07	263.80	109.14-16	109.36-37

日付	1/10	1/11	1/15	1/16	1/17
日銀当預残	3,862,500	3,862,000	3,861,800	3,877,800	3,864,600
準備預金残	3,396,300	3,383,100	3,373,600	3,373,200	3,366,200
マネタリーベース	4,992,900	4,989,900	4,987,300	5,000,500	4,985,900
無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.058%	▲0.062%	▲0.068%	▲0.062%
コール市場残高	108,152	104,196	108,711	88,274	100,001
うち無担	83,350	78,228	83,384	74,887	86,309
うちO/N	51,165	47,123	53,894	44,977	55,429
うち有担	24,802	25,968	25,327	13,387	13,692

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	809	－	43,400	2019/1/21	2019/4/22	134,031.0	35,137.5	100.0450	▲0.1804%	55.9132%	100.0469	▲0.1880%	8,262.0
流動性供給	277	－	6,000	2019/1/21		20,908.0	5,982.0		0.0090%	76.9050%		0.0080%	
交付税特会	－	－	10,500	2019/1/28	2019/7/30	240,421.0	10,500.16		0.0000%	4.3893%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2019/1/21	2019/2/4		1,706	1,706				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	35,678	2019/1/18	2019/1/21		4	4		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月21日の予定

*New York祝日(Martin L.King Jr.'s Day)

◆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論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