

Central Daily Market Report

2019年1月21日(月)
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21日 需給速報	2019年1月22日 需給予想	2019年1月23日 当社予想
銀行券	1,500	900	0
財政	▲ 19,800	1,400	▲ 3,000
資金過不足	▲ 18,300	2,300	▲ 3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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			10,300
CP等買入	2,500	▲ 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			500
国債補充供給			
当預増減	▲ 16,200	13,000	▲ 3,000
当座預金残高	3,853,400	3,866,400	3,863,400
準備預金残高	3,343,300		
積み終了先	3,335,200		1月22日以降の残り所要積立額
超過準備	3,333,900		積数 19,800
非準備預金先	510,100		1日平均 800
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	99.37%	日数 19.35%

●2019年1月21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。引き続き取り急ぐような動きはみられず、一巡後は▲0.08%程度の出合いが見ら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(1/21-1/22)は▲0.120~▲0.100%程度での出合い、T/N(1/22-1/23)は▲0.145~▲0.110%程度での出合い。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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.200~▲0.195%、1Y物が▲0.195%で少額出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は卸売業態から大型案件が実施され、発行総額は1,300億円程度、償還総額は200億円となり発行超のマーケットとなった。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

2019/1/21	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	▲ 0.067				-	▲ 0.119	0.000	▲ 0.006	20,719.33	53.26	109.67-69	109.57-59
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.138						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.143						
2W	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.036				-	▲ 0.148						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.149						
1M			▲ 0.033				-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.195	▲ 0.159						
6M							▲ 0.200	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.159						
									日付	1/11	1/15	1/16	1/17	1/18
									日銀当預残	3,862,000	3,861,800	3,877,800	3,864,600	3,869,600
									準備預金残	3,383,100	3,373,600	3,373,200	3,366,200	3,367,600
									マネタリーベース	4,989,900	4,987,300	5,000,500	4,985,900	4,989,400
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.062%	▲0.068%	▲0.062%	▲0.067%
									コール市場残高	104,196	108,711	88,274	100,001	93,293
									うち無担	78,228	83,384	74,887	86,309	80,128
									うちO/N	47,123	53,894	44,977	55,429	49,898
									うち有担	25,968	25,327	13,387	13,692	13,165

●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	2019/1/22			8,222	3,503	0.004		0.007	90.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/1/22			8,953	4,008	0.002		0.003	67.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/1/22			5,238	2,009	▲0.002		0.000	14.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/1/22			1,848	502	0.004		0.005	84.4
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	23,794	2019/1/21	2019/1/22		0	0				

●2019年1月22日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、23日まで)	*米国12月の中古住宅販売	*流動性供給入札(4,000億円、1/23発行)
		*交付税特別会計借入(10,500億円、1/30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