

Central Daily Market Report

2019年1月22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22日 需給速報		2019年1月23日 需給予想		2019年1月24日 当社予想	
銀行券	800		400		▲ 1,000	
財政	2,600		▲ 4,900		▲ 4,000	
資金過不足	3,400		▲ 4,500		▲ 5,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 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	500					
国債補充供給						
当預増減	14,100		300		▲ 5,000	
当座預金残高	3,867,500		3,867,800		3,862,800	
準備預金残高	3,363,700					
積み終了先	3,361,000		1月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,359,700		積数		15,800	
非準備預金先	503,800		1日平均		700	
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	99.50%	日数	22.58%		

●2019年1月22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。引き続き調達ニーズは弱く、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(1/22-1/23)は▲0.130~▲0.100%程度での出合い、T/N(1/23-1/24)は▲0.160~▲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。アウトライト市場では、短国買入オペが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が2兆円弱と多く、平均落札利回り較差+0.010%、按分落札利回り較差+0.003%と弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.195%、1Y物が▲0.195~▲0.189%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は卸売業態から大型案件が実施され、発行総額は1,500億円程度となり、償還総額700億円に対して発行超となった。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

2019/1/22	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.150	0.001	▲ 0.067					-	▲ 0.117	▲ 0.005	▲ 0.005	20,622.91	▲ 96.42	109.66-68	109.42-43		
T/N			▲ 0.020					-	▲ 0.144								
S/N								-	-								
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.026					-	▲ 0.145								
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.015					-	▲ 0.149								
3W								-	▲ 0.150								
1M								-	▲ 0.152								
3M								▲ 0.195	▲ 0.159								
6M								▲ 0.200	▲ 0.160								
1Y								▲ 0.195	▲ 0.160								
												日付	1/15	1/16	1/17	1/18	1/21
												日銀当預残	3,861,800	3,877,800	3,864,600	3,869,600	3,853,400
												準備預金残	3,373,600	3,373,200	3,366,200	3,367,600	3,343,300
												マネタリーベース	4,987,300	5,000,500	4,985,900	4,989,400	4,971,700
												無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.068%	▲0.062%	▲0.067%	▲0.067%
												コール市場残高	108,711	88,274	100,001	93,293	92,355
												うち無担	83,384	74,887	86,309	80,128	78,351
												うちO/N	53,894	44,977	55,429	49,898	47,411
												うち有担	25,327	13,387	13,692	13,165	14,004

●入札結果

名称	回数	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)
流動性供給	278	-	4,000	2019/1/23		22,118.0	3,990.0		▲0.0030%	4.0978%		▲0.0060%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/1/30	2019/8/1	253,005.0	10,500.13		0.0000%	4.1502%		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	2019/1/23			19,404	5,002	0.003			63.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,000	2019/1/22	2019/1/23		39	39		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月23日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
*黒田日銀総裁定例会見
*経済・物価情勢の展望

*12月の貿易統計

◆本資料は信頼できるとさ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よう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ことがあります。金融商品取引法に基づきお読みする書面や目論見書をよくお読みください。