Central Daily Market Report

2019年1月24日（木）
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24日 需給速報		2019年1月25日 需給予想		2019年1月28日 当社予想	
銀行券	▲ 100		100		1,000	
財政	▲ 1,300		3,200		2,000	
資金過不足	▲ 1,400		3,300		3,000	
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						▲ 5,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
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		100				
当預増減	▲ 1,100		2,900		▲ 2,100	

当座預金残高	3,864,000	3,866,900	3,864,800
準備預金残高	3,365,400		
積み終了先	3,364,100		
超過準備	3,363,800		
非準備預金先	498,600		

1月25日以降の残り所要積立額	
積数	11,500
1日平均	500

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	99.63%	日数 29.03%

●2019年1月24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%近辺の調整程度の出合いが数件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本日も目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(1/24-1/25)は▲0.120～▲0.105%程度での出合い、T/N(1/25-1/28)は▲0.13～▲0.10%程度での出合いとなり、狭いレンジの取引となった。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。アウトライト市場は、翌日に3M物の入札を控えて様子見閑散な中、3M物が▲0.195～▲0.192%、1Y物が▲0.195%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、石油業態等がまとまった発行を実施し、800億円強の償還に対して、1,000億円強の発行が見られる発行超のマーケットとなった。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となっている。

●短期金融市場関連指標

2019/1/24	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	▲ 0.066				－	▲ 0.108
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.122
S/N							－	－
1W			▲ 0.045				－	▲ 0.126
2W			▲ 0.017				－	▲ 0.130
3W							－	▲ 0.132
1M			▲ 0.003				－	▲ 0.138
3M							▲ 0.195	▲ 0.155
6M							▲ 0.200	▲ 0.159
1Y							▲ 0.195	▲ 0.159

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）
0.005	0.005	20,574.63	▲ 19.09	109.49-51	109.71-72

日付	1/17	1/18	1/21	1/22	1/23
日銀当預残	3,864,600	3,869,600	3,853,400	3,867,500	3,865,100
準備預金残	3,366,200	3,367,600	3,343,300	3,363,800	3,362,600
マネタリーベース	4,985,900	4,989,400	4,971,700	4,985,000	4,982,200
無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.067%
コール市場残高	100,001	93,293	92,355	93,197	97,073
うち無担	86,309	80,128	78,351	79,473	82,821
うちO/N	55,429	49,898	47,411	47,988	50,601
うち有担	13,692	13,165	14,004	13,724	14,252

●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)
20年利付国債	167	0.50%	10,000	2019/1/25	2038/12/20	36,618.0	8,009.00	100.5500	0.4690%	24.2842%	100.5900	0.4670%	1,982.0

●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
社債等買入	750	2019/1/30			2,130	750	0.053		0.071	18.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	12,131	2019/1/24	2019/1/25		7	7		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月25日の予定

*1月の都区部消費者物価指数(CPI)
市場予想：前年同月比(除く生鮮)＋0.9%

*米国12月の新築一戸建て販売件数
*米国12月の耐久財新規受注

*国庫短期証券(810回)入札
（3ヶ月、43,400億円、1/28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