

Central Daily Market Report

2019年1月29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29日		2019年1月30日		2019年1月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		700		▲ 400	
財政	▲ 2,900		▲ 3,300		▲ 2,500	
資金過不足	▲ 2,800		▲ 2,600		▲ 2,900	
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			2,500			
国債買入	10,400					
CP等買入		▲ 200		▲ 200	2,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			800			
E T F買入	200					
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	7,500		600		▲ 400	
当座預金残高	3,884,200		3,884,800		3,884,400	
準備預金残高	3,386,700					
積み終了先	3,385,500				1月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,385,500				積数 6,200	
非準備預金先	497,500				1日平均 400	
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	99.80%	日数	45.16%		

●2019年1月29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、一巡後も▲0.08%近辺の調整程度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目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(1/29-1/30)は▲0.145~▲0.11%程度、T/N(1/30-1/31)は▲0.135~▲0.10%程度の出合いで、引き続きレート横ばい圏だった。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10Y341や、5Y126、127、129、130、131、134などにビッドが目立った。リオープンとなった40Y11は緩んだが、引け頃にかけてビッドが集まる場面があった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回は▲2,500億円)でオファーされた。応札額が約1.2兆円と多く、平均落札利回較差+0.046%、按分落札利回較差+0.036%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りから弱めの結果となった。マーケットでは、引け際に3M物が▲0.280%で、1Y物が▲0.210%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発行市場は月末発行のため幅広い業態で大型発行が相次ぎ、活況なマーケットとなった。償還総額1兆4,600億円に対して、発行総額は1兆1,000億円となり償還超のマーケットとなった。発行レートは0%付近での決着が中心で、変動はなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/1/29	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.119	0.000	0.005	20,664.64	15.64	109.24-26	109.23-24		
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.128								
S/N							-	-								
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.127								
2W			▲ 0.029				-	▲ 0.126								
3W							-	▲ 0.131								
1M	▲ 0.025	0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.136								
3M							▲ 0.277	▲ 0.155								
6M							▲ 0.200	▲ 0.159								
1Y							▲ 0.210	▲ 0.158								
											日付	1/22	1/23	1/24	1/25	1/28
											日銀当預残	3,867,500	3,865,100	3,864,000	3,866,500	3,876,700
											準備預金残	3,363,800	3,362,600	3,365,400	3,365,900	3,377,600
											マネタリーベース	4,985,000	4,982,200	4,981,100	4,983,600	4,993,200
											無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.062%
											コール市場残高	93,197	97,073	99,437	96,641	102,011
											うち無担	79,473	82,821	82,776	80,872	77,083
											うちO/N	47,988	50,601	49,026	47,592	44,413
											うち有担	13,724	14,252	16,661	15,769	24,928

●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)
40年利付国債	11	0.80%	4,000	2019/1/30	2058/3/20	15,127.0	3,995.00		0.7400%	10.2272%			
交付税特会	-	-	10,500	2019/2/6	2019/8/8	245,862.0	10,500.10		0.0000%	4.2708%		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	2,500	2019/1/30			12,547	2,503	0.036		0.046	3.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	26,909	2019/1/29	2019/1/30		1	1		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,068	2019/1/29	2019/1/30		137	137		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/1/31	2019/2/7	2.9	1	1				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2019/1/30	2019/2/8		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2019年1月30日の予定

*12月の商業動態統計速報	*米国FOMC(2日目)
*1月の消費動向調査	*米国10-12月期のGDP速報値
	*米国1月のCB消費者信頼感指数

◆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