

Central Daily Market Report

2019年1月30日(水)
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30日		2019年1月31日		2019年2月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		▲ 200		0	
財政	▲ 4,700		▲ 2,400		▲ 27,000	
資金過不足	▲ 4,000		▲ 2,600		▲ 27,000	
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	2,500					
国債買入			4,900			
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800			▲ 100		
E T F 買入			1,200			
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 800		4,800		▲ 27,000	
当座預金残高	3,883,400		3,888,200		3,861,200	
準備預金残高	3,381,900					
積み終了先	3,380,700		1月31日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,380,700		積数		4,900	
非準備預金先	501,500		1日平均		300	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,141,600	
準備預金進捗率	実績	99.84%	日数	48.39%		

●2019年1月30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。引き続き弱めの地合いは変わらず、一巡後は▲0.08%近辺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目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(1/30-1/31)は▲0.11~▲0.10%程度、T/N(1/31-2/1)は▲0.135~▲0.10%程度の出合いだった。T/Nの取引は月末初にあたったが、調達サイドがしっかりしており、出合いのレンジは前日から横ばい圏だった。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10Y337、341や、5Y126、127、129、130、131、134などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.264~▲0.250%、1Y物が▲0.210%の出合いと、引き続き特定の銘柄のみが出合う状況となっている。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は卸売・その他金融業態で大型案件が実施され、償還総額100億円程度に対して、発行総額は2,400億円程度まで膨らんだ。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

2019/1/30	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	売買参考算計値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.109		0.000	0.000	20,556.54	▲ 108.10	109.42-43	109.31-33		
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.125									
S/N							-	-									
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.126									
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.126									
3W			0.000				-	▲ 0.129									
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.135									
3M			0.070				▲ 0.250	▲ 0.156									
6M							▲ 0.200	▲ 0.159									
1Y							▲ 0.210	▲ 0.158									
												日付	1/23	1/24	1/25	1/28	1/29
												日銀当預残	3,865,100	3,864,000	3,866,500	3,876,700	3,884,200
												準備預金残高	3,362,600	3,365,400	3,365,900	3,377,600	3,386,700
												マネタリーベース	4,982,200	4,981,100	4,983,600	4,993,200	5,000,700
												無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.064%
												コール市場残高	97,073	99,437	96,641	102,011	95,965
												うち無担	82,821	82,776	80,872	77,083	77,778
												うちO/N	50,601	49,026	47,592	44,413	45,718
												うち有担	14,252	16,661	15,769	24,928	18,187

●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	棄分率	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)	着札総額(億円・百万ドル)	投分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均着札レート・利回較差・価格較差	投分比率
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/1/31			1,236	504	0.000		0.007	47.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/1/31			14,411	4,310	0.003		0.004	39.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,368	2019/1/30	2019/1/31		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月31日の予定

*両宮日銀副総裁、山口県金融経済懇談会にて講演	*米国12月の個人所得・消費支出	*2年利付国債入札(21,000億円、2/1発行)
*決定会合における主な意見(1月22、23日分)	*米国1月のシカゴPM景況感指数	
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲0.4%)	*ユーロ圏10-12月期のGDP1次速報	
*12月の住宅着工統計		

◆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ことがあります。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。