

Central Daily Market Report

2019年1月31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31日		2019年2月1日		2019年2月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		400		1,000	
財政	▲ 3,200		▲ 28,300		▲ 70,000	
資金過不足	▲ 3,400		▲ 27,900		▲ 69,000	
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						▲ 1,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,900					
CP等買入	2,500	▲ 1,100		▲ 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		▲ 100				
E T F買入	1,200					
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	3,800		▲ 27,800		▲ 70,700	
当座預金残高	3,887,200		3,859,400		3,788,700	
準備預金残高	3,385,100					
積み終了先	3,383,900				2月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,383,900				積数	3,800
非準備預金先	502,100				1日平均	300
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額						3,134,800
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	51.61%		

●2019年1月31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。月末要因によりビッドの件数が減少し、昨日よりも軟調な展開となった。一巡後は目立った出合いはなく、閑散な地合いで今月の取引を終えた。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(1/31-2/1)は▲0.13~▲0.09%程度、T/N(2/1-2/4)は▲0.11~▲0.09%程度の出合いだった。積みの後半に入って調達サイドがしっかりしており、レートは小幅に上昇した。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、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)は小幅上昇。アウトライト市場は、翌日の3M物入札を控えて様子見で、引け際に1Y物が▲0.210%で出合う程度の閑散なマーケットだった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場はその他金融業態が1社で1,000億円を超える大型案件を実施したものの、件数は少なかった。償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,800億円程度と発行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

2019/1/31	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	▲ 0.060				-	▲ 0.100	▲ 0.001	▲ 0.001	20,773.49	216.95	108.97-99	108.72-74
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.047	▲ 0.017	▲ 0.026				-	▲ 0.113						
2W	▲ 0.037	▲ 0.010	▲ 0.025				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.121						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.250	▲ 0.162						
6M							▲ 0.200	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.159						
									日付	1/24	1/25	1/28	1/29	1/30
									日銀当預残	3,864,000	3,866,500	3,876,700	3,884,200	3,883,400
									準備預金残	3,365,400	3,365,900	3,377,600	3,386,700	3,382,200
									マネタリーベース	4,981,100	4,983,600	4,993,200	5,000,700	4,999,200
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	99,437	96,641	102,011	95,965	99,756
									うち無担	82,776	80,872	77,083	77,778	78,609
									うちO/N	49,026	47,592	44,413	45,718	46,349
									うち有担	16,661	15,769	24,928	18,187	21,147

●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)
2年利付国債	397	0.10%	21,000	2019/2/1	2021/2/1	103,401.0	17,020.00	100.5350	▲0.1660%	28.8273%	100.5370	▲0.1670%	3,969.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	117,525	2019/1/31	2019/2/1		198	198		▲0.600	▲0.600	

●2019年2月1日の予定

- *12月の完全失業率(市場予想：2.4%)
- *12月の有効求人倍率(市場予想：1.63倍)
- *米国12月の建設支出
- *米国1月の雇用統計
- *米国1月のISM製造業景況指数
- *ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値
- *国庫短期証券(811回)入札(3ヶ月、43,400億円、2/4発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、2/13借入)

◆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