

Central Daily Market Report

2020年1月6日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2020年1月6日 需給速報	2020年1月7日 需給予想	2020年1月8日 当社予想			
銀行券	6,300	5,800	5,000			
財政	▲ 21,000	5,300	▲ 48,000			
資金過不足	▲ 14,700	11,100	▲ 43,000			
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						
国債買入			9,300			
CP等買入				▲ 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						
E T F 買入						
国債補完供給		900				
当預増減	▲ 13,800	20,300	▲ 43,000			
当座預金残高	3,991,700	4,012,000	3,969,000			
準備預金残高	3,469,600					
積み終了先	3,469,300			1月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,469,300			積数	1,900	
非準備預金先	522,100			1日平均	200	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						3,226,800
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	70.97%		

●2020年1月6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・外銀を中心に▲0.087~▲0.040%での調達で始まった。立ち上がりこそ様子見姿勢が強かったものの、四半期末要因が剥落したことで、資金調達サイドで動く先も散見された。一巡後は調整から▲0.087%の出合いが見られた。ターム物はショートタームの積み期間内の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/7-1/8)は、▲0.110~▲0.09%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2Y402~407、10Y335~356、5Y136~141、20Y167~170、30Y59~64、40Y9~12等にビッグの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、世界的なリスクオフの流れで債券相場全体が上昇する中、1Y物が▲0.134~▲0.125%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と発行超であった。案件数は少なかったものの、卸売・医薬品業態において大型発行が行われたため、年始としてはやや活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/6	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	
	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.104	▲ 0.035	▲ 0.010	23,204.86	▲ 451.76	107.97-98	108.10-11
T/N							-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.002	0.001				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.093						
3W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.110	▲ 0.109						
6M							▲ 0.145	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.165						
									日付	12/24	12/25	12/26	12/27	12/30
									日銀当預残	4,023,500	4,021,800	4,022,200	4,014,400	4,005,500
									準備預金残	3,498,100	3,515,600	3,510,400	3,502,500	3,477,800
									マネタリーベース	5,186,600	5,188,500	5,194,000	5,190,400	5,182,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.051%	▲ 0.068%
									コール市場残高	103,796	105,442	101,934	100,663	69,110
									うち無担	80,302	81,346	81,072	79,941	48,716
									うちO/N	48,137	49,181	48,657	49,076	34,616
									うち有担	23,494	24,096	20,862	20,722	20,394

●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	案分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/1/7			7,223	4,204	▲0.030		▲0.026	66.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/1/7			9,659	3,403	▲0.032		▲0.031	8.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2020/1/7			5,133	1,008	▲0.030		▲0.027	15.6
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/1/7			1,301	303	▲0.034		▲0.033	54.8
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2020/1/6	2020/1/7	-0.35		34		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月7日の予定

*12月実績/1月見込み財政資金対民間収支	*米国11月の貿易収支	*国庫短期証券(879回)入札(3ヶ月、43,400億円、1/8発行)
*12月のマネタリーベース	*米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(21,000億円、1/8発行)
	*米国12月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、1/17借入)
	*ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値	

◆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