

# Central Daily Market Report

2020年1月7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	2020年1月7日 需給速報	2020年1月8日 需給予想	2020年1月9日 当社予想	
銀行券	5,700	4,100	4,000	
財政	6,000	▲ 55,000	3,000	
資金過不足	11,700	▲ 50,900	7,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
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		100		
国債補完供給	▲ 200	200		
当預増減	20,700	▲ 50,600	7,000	
当座預金残高	4,012,400	3,961,800	3,968,800	
準備預金残高	3,491,900			
積み終了先	3,491,600			
超過準備	3,491,600			
非準備預金先	520,500			
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	99.95%	日数	74.19%

## ●2020年1月7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▲0.085～▲0.040%での調達で始まった。昨日と横ばい圏で推移し、一巡後は▲0.085～▲0.050%の調整の出合いが見られた。ターム物は引き続きショートターム物の出合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(1/8-1/9)は、▲0.080～▲0.050%程度での出合い。TDBと10年債発行が重なったことで、売物が増加している。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等にビッドの出入りがあった。

### ＜短国市場＞

現先レート(T/N)は、レート上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.113～▲0.110%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1086%、按分落札利回▲0.0984%と、今週中に残り2回の入札を控えていることもあってか、甘めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいても、▲0.105%出合いと、按分レート近辺で推移した。この他に、引け際に1Y物が▲0.132%で出合った。

### ＜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1,500億円程度に対して、発行総額は1,100億円程度と償還超であった。卸売・電気機器業態において大型発行が行われたものの、案件数は少なくやや閑散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

2020/1/7	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.092	▲ 0.010	0.025	23,575.72	370.86	108.41-42	108.32-34
T/N							-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.042				-	▲ 0.073						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.076						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.083						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.089						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.136	▲ 0.164						
									日付	12/25	12/26	12/27	12/30	1/6
									日銀当預残	4,021,800	4,022,200	4,014,400	4,005,500	3,991,700
									準備預金残	3,515,600	3,510,400	3,502,500	3,477,800	3,470,400
									マネタリーベース	5,188,500	5,194,000	5,190,400	5,182,500	5,162,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.051%	▲ 0.068%	▲ 0.061%
									コール市場残高	105,442	101,934	100,663	69,110	89,222
									うち無担	81,346	81,072	79,941	48,716	67,462
									うちO/N	49,181	48,657	49,076	34,616	44,472
									うち有担	24,096	20,862	20,722	20,394	21,760

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額 (億円)	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)
国庫短期証券	879	-	43,400	2020/1/8	2020/4/6	123,143.0	35,524.7	100.0240	▲0.0984%	66.7457%	100.0265	▲0.1086%	7,875.0
10年利付国債	357	0.10%	21,000	2020/1/8	2029/12/20	63,436.0	17,126.0	101.0300	▲0.0030%	78.8770%	101.0500	▲0.0050%	3,861.0
交付税特会	-	-	10,500	2020/1/17	2020/7/17	265,156.0	10,500.14		0.0000%	3.9600%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/7	2020/1/8	▲ 0.350	158	158		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/1/9	2020/1/16	2.050	0	0				

## ●2020年1月8日の予定

\*11月の毎月勤労統計調査速報

\*12月の消費動向調査

\*1月の日銀当座預金増減要因見込み

\*米国11月の消費者信用残高

◆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