

Central Daily Market Report

2020年1月8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	2020年1月8日		2020年1月9日		2020年1月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	4,300		2,700		3,000	
財政	▲ 53,900		4,700		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 49,600		7,400		▲ 6,000	
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						
CP等買入				▲ 200		
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				
当預増減	▲ 49,300		7,200		▲ 6,000	
当座預金残高	3,963,100		3,970,300		3,964,300	
準備預金残高	3,455,300					
積み終了先	3,455,100				1月9日以降の残り所要積立額	
超過準備					積数 1,300	
非準備預金先	507,800				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	99.96%	日数	77.42%		

●2020年1月8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▲0.080~▲0.040%のレンジでの出会いとなった。税揚げ日の取引となり、大手行を中心に調達ニーズの強まりが見られたが、全体のレートを引き上げるまでには至らず、一巡後は▲0.080~▲0.050%で調整の出会いが見られた程度であった。ターム物は特段目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/9-1/10)は、▲0.070~▲0.050%程度での出会い。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等にビッドの出入りがあった。

<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、在庫調整の売りからか、3M物が▲0.110%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1,300億円程度に対して、発行総額は3,800億円程度と大きく発行超であった。5・10日発行となり鉄鋼・卸売等の業態において大型案件が見られ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

2020/1/8	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.061	▲ 0.015	▲ 0.005	23,204.76	▲ 370.96	108.00-02	108.41-42
T/N							-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.002	▲ 0.022				-	▲ 0.061						
2W	▲ 0.015	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.068						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.073						
1M							-	▲ 0.082						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.145	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.163						
									日付	12/26	12/27	12/30	1/6	1/7
									日銀当預残	4,022,200	4,014,400	4,005,500	3,991,700	4,012,400
									準備預金残	3,510,400	3,502,500	3,477,800	3,470,400	3,491,900
									マネタリーベース	5,194,000	5,190,400	5,182,500	5,162,400	5,177,300
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.051%	▲0.068%	▲0.061%	▲0.064%
									コール市場残高	101,934	100,663	69,110	89,222	98,940
									うち無担	81,072	79,941	48,716	67,462	76,338
									うちO/N	48,657	49,076	34,616	44,472	50,963
									うち有担	20,862	20,722	20,394	21,760	22,602

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/8	2020/1/9	▲ 0.350	21	21		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年1月9日の予定

*国庫短期証券(880回)入札 (6ヶ月、23,000億円、1/10発行)	*30年利付国債入札 (7,000億円、1/10発行)	*エネルギー対策借入 (5,000億円、1/20借入)
--	--------------------------------	--------------------------------

◆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