

Central Daily Market Report

2020年1月9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	2020年1月9日		2020年1月10日		2020年1月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,700		2,500		3,000	
財政	3,300		▲4,700		▲4,000	
資金過不足	6,000		▲2,200		▲1,000	
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						▲6,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲200		▲400		
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	▲100			100		
当預増減	5,700		▲2,500		▲7,000	
当座預金残高	3,968,800		3,966,300		3,959,300	
準備預金残高	3,453,500					
積み終了先	3,453,200					1月10日以降の残り所要積立額
超過準備	3,453,200					積数 1,100
非準備預金先	515,300					1日平均 200
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額						3,233,900
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	80.65%		

●2020年1月9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。調達ニーズの高まりから、一巡後に取り上がる先も見られた。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(1/10-1/14)は、▲0.110～▲0.080%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、レート低下。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.113～▲0.110%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1182%、按分落札利回▲0.1162%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.149～▲0.140%出会いと強含みで推移した。この他、3M物が▲0.109%、1Y物が▲0.140～▲0.136%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3,500億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と大きく償還超であった。一部の卸売業態において大型発行があったものの、小型案件を中心とする落ち着いた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

2020/1/9	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	▲0.052				-	▲0.083	▲0.005	0.010	23,739.87	535.11	109.03-05	109.34-36
T/N							-	▲0.086						
S/N							-	-						
1W	▲0.045	0.002	▲0.024				-	▲0.083						
2W	▲0.005	0.000	▲0.003				-	▲0.083						
3W							-	▲0.088						
1M			▲0.020				-	▲0.093						
3M							▲0.125	▲0.106						
6M							▲0.145	▲0.143						
1Y							▲0.142	▲0.163						
									日付	12/27	12/30	1/6	1/7	1/8
									日銀当預残	4,014,400	4,005,500	3,991,700	4,012,400	3,963,100
									準備預金残	3,502,500	3,477,800	3,470,400	3,491,900	3,452,800
									マネタリーベース	5,190,400	5,182,500	5,162,400	5,177,300	5,123,800
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.068%	▲0.061%	▲0.064%	▲0.061%
									コール市場残高	100,663	69,110	89,222	98,940	102,613
									うち無担	79,941	48,716	67,462	76,338	77,028
									うちO/N	49,076	34,616	44,472	50,963	50,068
									うち有担	20,722	20,394	21,760	22,602	25,585

●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)
国庫短期証券	880	-	23,000	2020/1/10	2020/7/10	90,285.0	18,835.7	100.0580	▲0.1162%	48.9213%	100.0590	▲0.1182%	4,164.0
30年利付国債	65	0.40%	7,000	2020/1/10	2049/12/20	20,872.0	5,710.0	99.1000	0.4330%	5.2076%	99.1800	0.4300%	1,280.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2020/1/20	2021/1/20	101,770.0	4,999.96		0.0000%	4.9131%		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)		2020/1/9	2020/1/10	▲0.350	88	88		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月10日の予定

*11月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲1.7%)	*米国11月の卸売売上高	*国庫短期証券(881回)入札 (3ヶ月、43,400億円、1/14発行)
*11月の景気動向指数速報	*米国12月の雇用統計	
*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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