

Central Daily Market Report

2020年1月10日(金)

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10日		2020年1月14日		2020年1月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,600		3,100		2,000	
財政	▲ 5,100		▲ 400		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 2,500		2,700		▲ 10,000	
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			5,900	▲ 6,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,900			
CP等買入		▲ 400		▲ 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	▲ 300	100		300		
当預増減	▲ 3,100		14,400		▲ 10,000	
当座預金残高	3,965,700		3,980,100		3,970,100	
準備預金残高	3,442,800					
積み終了先	3,442,600		1月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,442,600		積数		300	
非準備預金先	522,900		1日平均		100	
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		99.99%		日数	
					93.55%	

●2020年1月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日を控えていることに加え、週末要因から調達意欲は強く、朝方は地銀・信託・証券・外銀を中心に▲0.040~▲0.025%のレンジでの出会いとなった。一巡後は閑散で目立った出会いは見られなかった。ターム物もオファーは少なく出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/14-1/15)は、▲0.10~▲0.085%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、小幅上昇。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▲0.130~▲0.120%で出合う展開となったものの、今週は短国入札が合計3回行われたこともあって、平均落札利回▲0.1175%、按分落札利回▲0.1074%と、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では、▲0.120%出会いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.150~▲0.148%、1Y物が▲0.142%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6,000億円程度と大きく発行超であった。5・10日発行となり卸売・電気機器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

2020/1/10	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.112	▲ 0.005	0.000	23,850.57	110.70	109.49-51	109.56-58
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.005	0.000	▲ 0.004				-	▲ 0.084						
3W			0.000				-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.120	▲ 0.107						
6M							▲ 0.150	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.163						
									日付	12/30	1/6	1/7	1/8	1/9
									日銀当預残	4,005,500	3,991,700	4,012,400	3,963,100	3,968,800
									準備預金残	3,477,800	3,470,400	3,491,900	3,452,800	3,453,900
									マネタリーベース	5,182,500	5,162,400	5,177,300	5,123,800	5,126,800
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.061%	▲0.064%	▲0.061%	▲0.052%
									コール市場残高	69,110	89,222	98,940	102,613	94,670
									うち無担	48,716	67,462	76,338	77,028	74,375
									うちO/N	34,616	44,472	50,963	50,068	46,515
									うち有担	20,394	21,760	22,602	25,585	20,295

●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	881	-	43,400	2020/1/14	2020/4/13	117,109.0	35,514.0	100.0265	▲0.1074%	6.8192%	100.0290	▲0.1175%	7,885.5

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2020/1/14	2020/1/27		5,878	5,878				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/1/14			11,253	4,204	▲0.010		▲0.008	58.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/1/14			11,569	3,405	▲0.002		▲0.001	18.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/1/14			7,960	3,515	0.002		0.003	85.3
国債買入(物価連動債)	300	2020/1/14			1,798	302	▲0.070		▲0.103	11.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/10	2020/1/14	▲ 0.350	316	316		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月13日の予定

*成人の日

*米国12月の財政収支

●2020年1月14日の予定

*11月の国際収支

*12月の景気ウォッチャー調査

*米国12月の消費者物価指数

◆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