

Central Daily Market Report

2020年1月14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14日		2020年1月15日		2020年1月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,100		2,600		2,000	
財政	2,100		▲ 5,500		▲ 16,000	
資金過不足	5,200		▲ 2,900		▲ 14,000	
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		1,500			
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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	▲ 200	300		200		
当預増減	16,700		▲ 1,500		▲ 14,000	
当座預金残高	3,982,400		3,980,900		3,966,900	
準備預金残高	3,483,800					
積み終了先	3,483,700					
超過準備	3,483,600					
非準備預金先	498,600					
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	100.00%	日数	96.77%		

●2020年1月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.040~▲0.020%の出会いが中心となった。先週末に強含んだ地合いを引き継ぎ、取り上がる先が多く見られた。一巡後はビッドが残る一方オファーが薄く、目立った出合いは見られなかった。ターム物もオファーは少なく、出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/15-1/16)は、▲0.09~▲0.04%程度での出合い。積み期間最終日にあたり、調達姿勢が強まる場面も見られた。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。アウトライト市場は、在庫調整の売りから、3M物で▲0.122~▲0.120%のまとまった出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は卸売やゴム業態で大型発行があり、償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/14	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.092	0.010	0.015	24,025.17	174.60	110.01-02	109.98-99
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			0.002				-	▲ 0.081						
2W							-	▲ 0.082						
3W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.084						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.122	▲ 0.105						
6M							▲ 0.150	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.161						
									日付	1/6	1/7	1/8	1/9	1/10
									日銀当預残	3,991,700	4,012,400	3,963,100	3,968,800	3,965,700
									準備預金残	3,470,400	3,491,900	3,452,800	3,453,900	3,443,300
									マネタリーベース	5,162,400	5,177,300	5,123,800	5,126,800	5,121,100
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.064%	▲0.061%	▲0.052%	▲0.035%
									コール市場残高	89,222	98,940	102,613	94,670	100,730
									うち無担	67,462	76,338	77,028	74,375	80,044
									うちO/N	44,472	50,963	50,068	46,515	50,619
									うち有担	21,760	22,602	25,585	20,295	20,686

●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10年超25年以下)	1,000	2020/1/15			3,723	1,007	0.011		0.012	22.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/1/15			1,561	303	0.008		0.008	90.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/14	2020/1/15	▲ 0.350	213	213		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/1/16	2020/1/24	2.050	0	0				

●2020年1月15日の予定

*11月の特定サービス産業動態統計速報	*米国12月の生産者物価指数	*5年利付国債入札(19,000億円、1/16発行)
*12月のマネーストック	*英国12月の消費者物価指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、1/24借入)

◆本資料は信頼できるとさ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