

Central Daily Market Report

2020年1月15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15日 需給速報	2020年1月16日 需給予想	2020年1月17日 当社予想
銀行券	2,500	1,700	1,000
財政	▲ 7,400	▲ 19,600	▲ 1,000
資金過不足	▲ 4,900	▲ 17,900	0
金融調節			
	スタート	エンド	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			10,000
国債買入	1,500		
CP等買入		▲ 300	▲ 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			600
国債補完供給	▲ 500	200	500
当預増減	▲ 4,000	▲ 6,900	0
当座預金残高	3,978,400	3,971,500	3,971,500
準備預金残高	3,480,700		
積み終了先	3,480,700		
超過準備	3,480,600		
非準備預金先	497,700		
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額		3,239,200	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数
			0.00%

●2020年1月15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・証券業態を中心に▲0.015~▲0.005%の出合い。積み最終日要因により、調整の調達ニーズが強く、取り上がる展開となった。一巡後も調整の動きが散見された。ターム物は引き続きオファーは少なく、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(1/16-1/17)は、▲0.075~▲0.065%程度での出合い。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、10Y335~357、5Y136~142、20Y167~170、30Y59~65、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。アウトライト市場では、短国買入オペが10,000億円(前回は+5,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.021%、按分落札利回較差+0.011%と、売り急ぐ動きは見られず、落ち着いた結果となった。マーケットでは、3M物で▲0.124~▲0.1225%、6M物で▲0.1475%、1Y物で▲0.144%の出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は不動産業態で大型発行があり、償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は1,500億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。本日はCP等買入オペが、予定通り2,500億円度でオファーされた。平均落札レート0%、按分レート▲0.001%と、前回は(平均0.001%、按分▲0.001%)で平均のみ低下した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/15 単位：%	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.076	0.005	▲ 0.005	23,916.58	▲ 108.59	109.85-86	109.90-92
T/N							-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.073						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.075						
3W							-	▲ 0.079						
1M	▲ 0.025	▲ 0.022	▲ 0.024				-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.124	▲ 0.103						
6M							▲ 0.145	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.161						
									日付	1/7	1/8	1/9	1/10	1/14
									日銀当預残	4,012,400	3,963,100	3,968,800	3,965,700	3,982,400
									準備預金残	3,491,900	3,452,800	3,453,900	3,443,300	3,485,000
									マネタリーベース	5,177,300	5,123,800	5,126,800	5,121,100	5,134,800
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.061%	▲0.052%	▲0.035%	▲0.028%
									コール市場残高	98,940	102,613	94,670	100,730	106,414
									うち無担	76,338	77,028	74,375	80,044	85,267
									うちO/N	50,963	50,068	46,515	50,619	56,862
									うち有担	22,602	25,585	20,295	20,686	21,147

●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)
5年利付国債	142	0.10%	19,000	2020/1/16	2024/12/20	69,919.0	15,603.00	100.9300	▲0.0870%	90.2740%	100.9300	▲0.0870%	3,388.0
交付税特会	-	-	10,500	2020/1/24	2020/7/27	277,947.0	10,500.00		0.0000%	3.7778%		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
国庫短期証券買入	10,000	2020/1/16			36,731	10,003	0.011		0.021	63.2
CP等買入	2,500	2020/1/20			9,220	2,484	▲0.001		0.000	15.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/15	2020/1/16	▲ 0.350	524	524		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第105回 2020/1/17	2021/1/15	0	0
被災地金融支援オペ(熊本)	第44回 2020/1/17	2021/1/15	0	2

●2020年1月16日の予定

*11月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.2%)	*米国11月の企業在庫 *米国12月の小売売上高	*国庫短期証券(882回)入札 (1年、19,000億円、1/20発行)
*12月の企業物価指数		

◆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