

Central Daily Market Report

2020年1月16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16日 需給速報	2020年1月17日 需給予想	2020年1月20日 当社予想
銀行券	1,700	2,200	2,000
財政	▲ 24,600	500	▲ 5,000
資金過不足	▲ 22,900	2,700	▲ 3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
	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		3,700	
CP等買入		▲ 100	2,500
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	▲ 800	500	800
当預増減	▲ 12,700	6,800	▲ 500
当座預金残高	3,965,700	3,972,500	3,972,000
準備預金残高	3,454,300		
積み終了先	1,619,800		1月17日以降の残り所要積立額
超過準備	874,000		積数 658.900
非準備預金先	511,400		1日平均 22.000
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	79.66%	日数 3.23%

●2020年1月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期に入ったことで、出合いレートは昨日に比べ低下した。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.055~▲0.03%、都銀・信託業態から▲0.08~▲0.075%のビッドとなった。業態毎に調達姿勢に違いが見られたことから、出合い水準は▲0.075~▲0.03%と幅広いレンジとなった。一巡後は▲0.075%~▲0.03%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/17-1/20)は、▲0.080~▲0.070%程度での出合い。SCはローラー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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.135~▲0.124%で出合う展開となったものの、平均落札利回▲0.1254%、按分落札利回▲0.1215%と、WI取引ほどの強さは見られない結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.137~▲0.130%出合いと強含みでの推移となった。この他に、6M物が▲0.144~▲0.140%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低値で推移した。CP発行市場は小売、建設業態で大型発行があり、償還総額2,400億円程度に対して、発行総額は2,900億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

2020/1/16	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.042					-	▲ 0.074	0.005	0.000	23,933.13	16.55	109.87-88	109.97-98
T/N								-	▲ 0.072						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.013					-	▲ 0.073						
2W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.008					-	▲ 0.074						
3W								-	▲ 0.078						
1M			▲ 0.022					-	▲ 0.083						
3M								▲ 0.124	▲ 0.100						
6M								▲ 0.144	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.137	▲ 0.159						
										日付	1/8	1/9	1/10	1/14	1/15
										日銀当預残	3,963,100	3,968,800	3,965,700	3,982,400	3,978,400
										準備預金残	3,452,800	3,453,900	3,443,300	3,485,000	3,480,700
										マネタリーベース	5,123,800	5,126,800	5,121,100	5,134,800	5,128,300
										無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.052%	▲0.035%	▲0.028%	▲0.016%
										コール市場残高	102,613	94,670	100,730	106,414	110,510
										うち無担	77,028	74,375	80,044	85,267	91,352
										うちO/N	50,068	46,515	50,619	56,862	62,347
										うち有担	25,585	20,295	20,686	21,147	19,158

●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	882	-	19,000	2020/1/20	2021/1/20	61,247.0	15,513.5	100.1220	▲0.1215%	0.7817%	100.1260	▲0.1254%	3,486.0

●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5年超10年以下)	3,500	2020/1/17			13,996	3,507	▲0.005		▲0.005	95.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/16	2020/1/17	▲0.350	774	774		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月17日の予定

*11月の第3次産業活動指数	*米国12月の住宅着工件数	*国庫短期証券(883回)入札
*11月の石油等消費動態統計	*米国12月の鉱工業生産・設備稼働率	(3ヶ月、43,400億円、1/20発行)
	*米国1月のミンガン大消費者信頼感指数速報	*20年利付国債入札
	*ユーロ圏12月の消費者物価指数改定値	(9,000億円、1/20発行)
		*交付税特別会計借入
		(10,500億円、1/28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