

●資金需給

単位：億円	2020年1月17日	2020年1月20日	2020年1月21日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	2,400	1,900	1,000
財政	100	▲ 11,100	1,000
資金過不足	2,500	▲ 9,200	2,000
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			
国債買入	3,700		
CP等買入		▲ 400	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		100	
国債補完供給	▲ 1,500	800	1,500
当預増減	5,100	▲ 5,300	2,000
当座預金残高	3,970,800	3,965,500	3,967,500
準備預金残高	3,456,400		
積み終了先	3,441,400	1月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,248,000	積数	38,200
非準備預金先	514,400	1日平均	1,400
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	98.82%	日数
			12.90%

●短期金融市場関連指標

2020/1/17	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.070
T/N							-	▲ 0.057
S/N							-	-
1W	▲ 0.005	0.002	▲ 0.002				-	▲ 0.061
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.062
3W							-	▲ 0.065
1M	▲ 0.025	▲ 0.022	▲ 0.024				-	▲ 0.072
3M							▲ 0.126	▲ 0.099
6M							▲ 0.144	▲ 0.134
1Y							▲ 0.142	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.005	▲ 0.010	24,041.26	108.13	110.17-18	110.20-22
日付	1/9	1/10	1/14	1/15	1/16
日銀当預残	3,968,800	3,965,700	3,982,400	3,978,400	3,965,700
準備預金残	3,453,900	3,443,300	3,485,000	3,480,700	3,454,300
マネタリーベース	5,126,800	5,121,100	5,134,800	5,128,300	5,113,800
無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.035%	▲ 0.028%	▲ 0.016%	▲ 0.042%
コール市場残高	94,670	100,730	106,414	110,510	93,356
うち無担	74,375	80,044	85,267	91,352	73,386
うちO/N	46,515	50,619	56,862	62,347	49,376
うち有担	20,295	20,686	21,147	19,158	19,970

●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	883	-	43,400	2020/1/20	2020/4/20	127,555.0	35,524.1	100.0280	▲0.1122%	70.9746%	100.0292	▲0.1170%	7,875.0
20年利付国債	171	0.30%	9,000	2020/1/20	2039/12/20	28,185.0	7,363.0	99.9000	0.3050%	93.4722%	99.9900	0.3000%	1,628.0
交付税特会	-	-	10,500	2020/1/28	2020/7/29	225,407.0	10,500.05		0.0000%	4.6583%		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)		2020/1/17	2020/1/20	▲ 0.350	1,441	1,441		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/1/17	2020/1/20	▲ 0.350	68	68		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年1月20日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目、21日まで)	*New York祝日(Martin L. King Jr.'s Day)
----------------------------	---------------------------------------

◆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。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論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