

Central Daily Market Report

2020年1月20日(月)
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20日		2020年1月21日		2020年1月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,800		1,500		1,000	
財政	▲ 11,000		1,700		1,000	
資金過不足	▲ 9,200		3,200		2,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,200			
CP等買入	2,500	▲ 200		▲ 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	100		100			
国債補完供給	▲ 100	1,500		100		
当預増減	▲ 5,400		11,500		2,000	
当座預金残高	3,965,400		3,976,900		3,978,900	
準備預金残高	3,440,800					
積み終了先	3,432,400				1月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,430,700				積数	
非準備預金先	524,600				1日平均	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,239,300	
準備預金進捗率	実績	99.14%	日数	16.13%		

●2020年1月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週に引き続き全体的に資金調達意欲が強く、高い水準での取引が中心となった。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.02~▲0.01%、都銀・信託業態から▲0.06~▲0.05%のビッドが入り、出合いの中心は▲0.07~▲0.005%のレンジとなった。一巡後は▲0.06~▲0.01%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、オファーサイドが少なく閑散なマーケットとなった。

<レポ市場>

GC T/N(1/21-1/22)は、▲0.060~▲0.045%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。アウトライト市場は、3M物で▲0.130%、6M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。発行市場は小型の案件が中心となり、発行総額は350億円程度と償還総額の400億円程度を若干下回った。発行レートについては、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/20	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	▲ 0.018				-	▲ 0.049	0.005	0.010	24,083.51	42.25	110.18-19	110.12-13
T/N							-	▲ 0.050						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				-	▲ 0.055						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.057						
3W							-	▲ 0.061						
1M							-	▲ 0.067						
3M							▲ 0.130	▲ 0.093						
6M							▲ 0.144	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.159						
									日付	1/10	1/14	1/15	1/16	1/17
									日銀当預残	3,965,700	3,982,400	3,978,400	3,965,700	3,970,800
									準備預金残	3,443,300	3,485,000	3,480,700	3,454,300	3,456,400
									マネタリーベース	5,121,100	5,134,800	5,128,300	5,113,800	5,116,500
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.028%	▲0.016%	▲0.042%	▲0.023%
									コール市場残高	100,730	106,414	110,510	93,356	103,691
									うち無担	80,044	85,267	91,352	73,386	84,271
									うちO/N	50,619	56,862	62,347	49,376	59,411
									うち有担	20,686	21,147	19,158	19,970	19,420

●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1年以下)	500	2020/1/21			1,804	501	0.006		0.010	60.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/1/21			13,459	4,207	0.000		0.001	50.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/1/21			11,423	3,407	0.001		0.001	68.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/20	2020/1/21	-0.35	30	30		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/1/20	2020/1/21	-0.35	25	25		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月21日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)
*黒田日銀総裁、定例会見
*経済・物価情勢の展望

◆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