Central Daily Market Report

2020年1月22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22日 需給速報		2020年1月23日 需給予想		2020年1月24日 当社予想	
銀行券	900		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 3,900		▲ 4,900		0	
資金過不足	▲ 3,000		▲ 5,000		▲ 1,000	
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			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 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						
ＥＴＦ買入	600					
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 2,500		4,900		▲ 1,000	

当座預金残高	3,971,700	3,976,600	3,975,600
準備預金残高	3,443,100		
積み終了先	3,439,800		
超過準備	3,439,300		
非準備預金先	528,600		

1月23日以降の残り所要積立額	
積数	17,500
1日平均	700

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	99.46%	日数 22.58%

●2020年1月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き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～▲0.005%、都銀・信託業態から▲0.07～▲0.04%のビッド。出合いの中心は▲0.04～▲0.005%のレンジとなった。一巡後は▲0.055～▲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(1/23-1/24)は、▲0.095～▲0.06%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、レート低下。アウトライト市場では、短国買入オペが市場予想を上回る10,000億円でオファーされた。平均落札利回較差＋0.014%、按分落札利回較差＋0.008%と、やや弱めの結果となった。マーケットでは、6M物で▲0.141%、1Y物で▲0.144～▲0.141%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。発行市場は鉄鋼業態で700億円超のまとまった額の調達がみられ、発行総額は2,200億円程度と償還総額の1,500億円程度を上回った。発行レートについては、特段の変化は見られず、全般的に横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/22	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.018				－	▲ 0.077
T/N							－	▲ 0.091
S/N							－	－
1W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.007				－	▲ 0.083
2W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.002				－	▲ 0.082
3W			0.001				－	▲ 0.083
1M							－	▲ 0.085
3M							▲ 0.130	▲ 0.099
6M							▲ 0.145	▲ 0.134
1Y							▲ 0.140	▲ 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	0.005	24,031.35	166.79	109.91-92	110.00-01

日付	1/15	1/16	1/17	1/20	1/21
日銀当預残	3,978,400	3,965,700	3,970,800	3,965,400	3,974,200
準備預金残	3,480,700	3,454,300	3,456,400	3,440,900	3,449,800
マネタリーベース	5,128,300	5,113,800	5,116,500	5,109,300	5,116,600
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.042%	▲0.023%	▲0.018%	▲0.018%
コール市場残高	110,510	93,356	103,691	99,464	95,547
うち無担	91,352	73,386	84,271	80,805	76,564
うちO/N	62,347	49,376	59,411	54,215	50,224
うち有担	19,158	19,970	19,420	18,659	18,983

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
流動性供給	301	－	6,000	2020/1/23		17,742.0	5,972.0		0.0020%	58.5686%		0.0000%	
交付税特会	－	－	10,500	2020/1/30	2020/7/31	235,992.0	10,500.01		0.0000%	4.4494%		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	2020/1/23			33,245	10,000	0.008		0.014	2.0
米ドル資金供給		2020/1/24	2020/1/30	2.040	0	0				

●2020年1月23日の予定

*11月の景気動向指数改訂状況
*12月の貿易統計
*ECB定例理事会（金融政策発表）

◆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。
◆本資料は何ら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