

Central Daily Market Report

2020年1月23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23日		2020年1月24日		2020年1月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		300		1,000	
財政	▲ 3,600		10,600		13,000	
資金過不足	▲ 3,800		10,900		14,000	
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						▲ 5,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入			5,600			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入						
国債補完供給						
当預増減	6,100		16,100		8,100	
当座預金残高	3,977,800		3,993,900		4,002,000	
準備預金残高	3,454,100					
積み終了先	3,450,700					
超過準備	3,450,700		1月24日以降の残り所要積立額		積数 14,100	
非準備預金先	523,700		1日平均		600	
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	99.56%	日数	25.81%		

●2020年1月23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%のビッドが見られた。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%近辺で散發的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。一部では試し取りによる+0.001%の出合いも見られた。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(1/24-1/27)は、▲0.08~▲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、レート上昇。アウトライト市場は、3M物で▲0.130%、引け際に6M物で▲0.145%の出合いが見られた。また、明日入札の884回(3M物)のWI取引において、▲0.125%で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、卸売業態でまとまった額の調達が行われ、発行総額は1,700億円程度と償還総額の700億円程度を上回った。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

2020/1/23	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.074	▲ 0.025	▲ 0.020	23,795.44	▲ 235.91	109.73-74	109.60-61
T/N							-	▲ 0.071						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	0.230	0.034				-	▲ 0.071						
2W							-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.075						
1M							-	▲ 0.079						
3M			0.070				▲ 0.130	▲ 0.099						
6M							▲ 0.145	▲ 0.132						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.159						
									日付	1/16	1/17	1/20	1/21	1/22
									日銀当預残	3,965,700	3,970,800	3,965,400	3,974,200	3,971,700
									準備預金残	3,454,300	3,456,400	3,440,900	3,449,800	3,443,300
									マネタリーベース	5,113,800	5,116,500	5,109,300	5,116,600	5,113,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.023%	▲ 0.018%	▲ 0.018%	▲ 0.018%
									コール市場残高	93,356	103,691	99,464	95,547	96,183
									うち無担	73,386	84,271	80,805	76,564	77,363
									うちO/N	49,376	59,411	54,215	50,224	50,913
									うち有担	19,970	19,420	18,659	18,983	18,820

●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5年超10年以下)	3,500	2020/1/24			9,506	3,514	▲0.012		▲0.012	80.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2020/1/24			3,273	1,009	▲0.012		▲0.011	92.7
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/1/24			1,283	301	▲0.010		▲0.009	26.2
国債買入(物価連動債)	300	2020/1/24			1,873	301	▲0.100		▲0.127	90.7
社債等買入	1,000	2020/1/29			3,151	1,000	0.055		0.064	81.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/23	2020/1/24	▲ 0.350	13	13		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年1月24日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(12月18、19日分)	*国庫短期証券(884回)入札
*12月の全国消費者物価指数(CPI)	(3ヶ月、43,400億円、1/27発行)
(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.7%)	*流動性供給入札
	(4,000億円、1/27発行)

◆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