

Central Daily Market Report

2020年1月24日(金)

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24日		2020年1月27日		2020年1月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		800		1,000	
財政	10,500		13,100		0	
資金過不足	10,800		13,900		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			7,000	▲5,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,600					
CP等買入		▲200		▲600		
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				
E T F 買入						
国債補完供給	▲200			200		
当預増減	15,800		14,600		1,000	
当座預金残高	3,993,600		4,008,200		4,009,200	
準備預金残高	3,463,500					
積み終了先	3,462,500		1月27日以降の残り所要積立額		積数 10,300	
超過準備	3,462,200				1日平均 500	
非準備預金先	530,100					
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	99.68%	日数	35.48%		

●2020年1月24日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、資金調達意欲が強いなか週末要因も重なり、引き続き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%、信託業態から▲0.045~▲0.035%のビッドが見られた。出合いの中心は▲0.035~▲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(1/27-1/28)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、20Y167~171、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.126~▲0.125%で出合う中、平均落札利回▲0.1222%、按分落札利回▲0.1162%と、落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.125~▲0.116%出合いと按分レート近辺で引けた。

＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。発行市場はノンバンク、卸売業態で比較的多とまった額の調達が見られたものの、案件はさほど膨らまず、償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は900億円程度となった。発行レートについては、引き続き0%近辺の狭いレンジで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/1/24	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	▲0.016				-	▲0.079	▲0.025	0.000	23,827.18	31.74	109.56-58	109.54-55
T/N							-	▲0.068						
S/N							-	-						
1W	▲0.010	0.002	▲0.005				-	▲0.070						
2W							-	▲0.071						
3W			0.000				-	▲0.073						
1M							-	▲0.078						
3M							▲0.120	▲0.098						
6M							▲0.145	▲0.133						
1Y							▲0.140	▲0.157						
									日付	1/17	1/20	1/21	1/22	1/23
									日銀当預残	3,970,800	3,965,400	3,974,200	3,971,700	3,977,800
									準備預金残	3,456,400	3,440,900	3,449,800	3,443,300	3,455,000
									マネタリーベース	5,116,500	5,109,300	5,116,600	5,113,300	5,119,600
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.018%
									コール市場残高	103,691	99,464	95,547	96,183	111,025
									うち無担	84,271	80,805	76,564	77,363	92,013
									うちO/N	59,411	54,215	50,224	50,913	65,108
									うち有担	19,420	18,659	18,983	18,820	19,012

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	884	-	43,400	2020/1/27	2020/4/27	120,487.0	35,414.4	100.0290	▲0.1162%	52.5257%	100.0305	▲0.1222%	7,985.0
流動性供給	302	-	4,000	2020/1/27		16,219.0	3,989.0		0.0010%	7.6856%		▲0.0010%	

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2020/1/27	2020/2/10		6,998	6,998				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/24	2020/1/27	▲0.350	193	193		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月27日の予定

*米国12月の新築一戸建て販売件数

◆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