

Central Daily Market Report

2020年1月28日(火)

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28日		2020年1月29日		2020年1月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		300		0	
財政	300		▲ 4,300		▲ 3,000	
資金過不足	800		▲ 4,000		▲ 3,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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			1,000			
E T F 買入	100		600			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	500		5,100		▲ 3,000	
当座預金残高	4,010,900		4,016,000		4,013,000	
準備預金残高	3,482,800					
積み終了先	3,482,100					
超過準備	3,482,100				1月29日以降の残り所要積立額 積数 8,400	
非準備預金先	528,100				1日平均 500	
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	99.74%	日数	41.94%		

●2020年1月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き高い水準が維持されているものの、徐々にビッドレートを引き下げる動きも見られた。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.02~▲0.01%、信託業態から▲0.04%のビッドが見られた。出会いの中心は▲0.04~▲0.01%のレンジとなった。一巡後は▲0.055~▲0.02%近辺で散発的な出会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(1/29-1/30)は、▲0.09~▲0.075%程度での出会い。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、低下。アウトライト市場では、短国買入オペが7,500億円と市場予想よりやや多めにオファーされ、平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.005%と、小甘い結果となった。マーケットでは、3M物で▲0.128~▲0.123%、6M物で▲0.147%、1Y物で▲0.152~▲0.146%と強めの出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、償還総額600億円弱に対して、発行総額は1,700億円弱に膨らみ、電力、ノンバンク等からは大口の発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏での決着となった。また、CP等買入オペが2,500億円でオファーされ、按分落札レート▲0.001%、平均落札レート0.002%の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/1/28	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.083	▲ 0.040	0.010	23,215.71	▲ 127.80	108.93-94	109.07-08
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.002	▲ 0.008				-	▲ 0.079						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.079						
3W			0.001				-	▲ 0.080						
1M							-	▲ 0.084						
3M							▲ 0.128	▲ 0.100						
6M							▲ 0.149	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.158						
									日付	1/21	1/22	1/23	1/24	1/27
									日銀当預残	3,974,200	3,971,700	3,977,800	3,993,600	4,010,400
									準備預金残	3,449,800	3,443,300	3,455,000	3,463,600	3,481,700
									マネタリーベース	5,116,600	5,113,300	5,119,600	5,135,100	5,151,200
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.016%	▲0.019%
									コール市場残高	95,547	96,183	111,025	103,093	97,941
									うち無担	76,564	77,363	92,013	83,595	78,501
									うちO/N	50,224	50,913	65,108	55,435	50,601
									うち有担	18,983	18,820	19,012	19,498	19,440

●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)
40年利付国債	12	0.50%	4,000	2020/1/29	2059/3/20	11,432.0	3,992.00		0.4000%	95.9031%			

●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	7,500	2020/1/29			18,980	7,502	0.005		0.007	87.7
CP等買入	2,500	2020/1/31			9,305	2,480	▲0.001		0.002	16.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/28	2020/1/29	▲ 0.350	110	110		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/1/30	2020/2/6	2.070	0	0				

●2020年1月29日の予定

*1月の消費動向調査	*米国FOMC(2日目)	*交付税特別会計借入
*決定会合における主な意見(1月20、21日分)	*米国1月のCB消費者信頼感指数	(10,500億円、2/7借入)

◆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