

# Central Daily Market Report

2020年1月29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29日		2020年1月30日		2020年1月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		200		500	
財政	▲ 3,300		6,200		3,700	
資金過不足	▲ 2,900		6,400		4,200	
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			12,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 200	2,500	
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	600		100			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	6,000		18,500		6,700	
当座預金残高	4,016,900		4,035,400		4,042,100	
準備預金残高	3,489,500					
積み終了先	3,489,100		1月30日以降の残り所要積立額		積数 7,900	
超過準備	3,489,100				1日平均 500	
非準備預金先	527,400					
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	99.76%	日数	45.16%		

## ●2020年1月29日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き調達レートを引き下げる動きが見られており、出会い水準は昨日に比べ低下した。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.02~▲0.015%、信託業態から▲0.045%のビッドが見られた。出会いの中心は▲0.045~▲0.015%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(1/30-1/31)は、▲0.150~▲0.095%程度での出会い。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、20Y167~171、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。アウトライト市場は、3M物が▲0.138~▲0.133%、1Y物が▲0.160~▲0.156%出会いと堅調に推移した。

### <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、月末発行にあたり、鉄鋼・電力・不動産等幅広い業態が大型発行を実施したが、1兆5,600億円強の償還に対して、1兆600億円強の発行にとどまる償還超のマーケットとなった。発行レートは、0%近辺の決着が中心となっている。

## ●短期金融市場関連指標

2020/1/29	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.101	▲ 0.040	0.000	23,379.40	163.69	109.13-14	109.09-10
T/N							-	▲ 0.124						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.104						
2W			0.000				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.138	▲ 0.105						
6M							▲ 0.149	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.158						
									日付	1/22	1/23	1/24	1/27	1/28
									日銀当預残	3,971,700	3,977,800	3,993,600	4,010,400	4,010,900
									準備預金残	3,443,300	3,455,000	3,463,600	3,481,700	3,482,800
									マネタリーベース	5,113,300	5,119,600	5,135,100	5,151,200	5,151,200
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.018%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.020%
									コール市場残高	96,183	111,025	103,093	97,941	103,631
									うち無担	77,363	92,013	83,595	78,501	84,423
									うちO/N	50,913	65,108	55,435	50,601	55,823
									うち有担	18,820	19,012	19,498	19,440	19,208

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2020/2/7	2020/8/7	229,231.0	10,500.23		0.0000%	4.5807%		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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2020/1/30			1,402	502	0.006		0.008	32.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/1/30			11,227	4,202	0.006		0.007	86.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2020/1/30			9,444	3,406	0.003		0.004	54.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/1/30			7,010	3,514	0.003		0.004	86.9
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2020/1/29	2020/1/30	-0.35	188	188		▲0.350	▲0.350	

## ●2020年1月30日の予定

*時事通信社「金融懇話会」において両宮副総裁講演	*2年利付国債入札(20,000億円、2/3発行)
*米国10-12月期のGDP速報値	
*英中銀MPC結果発表	

◆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