

# Central Daily Market Report

2020年1月30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30日		2020年1月31日		2020年2月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		400		2,000	
財政	5,400		▲1,600		▲28,000	
資金過不足	5,600		▲1,200		▲26,000	
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						
国債買入	12,000					
CP等買入		▲200	2,500	▲1,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲100		
E T F 買入	100					
国債補完供給	▲300	200		300		
当預増減	17,400		500		▲26,000	
当座預金残高	4,034,300		4,034,800		4,008,800	
準備預金残高	3,501,200					
積み終了先	3,500,500		1月31日以降の残り所要積立額		積数 7,300	
超過準備	3,500,500				1日平均 500	
非準備預金先	533,100					
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,239,900	
準備預金進捗率	実績	99.77%	日数	48.39%		

## ●2020年1月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日からの流れを引き継いで調達意欲が若干弱まったため、出合いレートは昨日に比べ低下した。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.035~▲0.015%、信託業態から▲0.05%のビッド。出合いの中心は▲0.05~▲0.015%のレンジとなった。一巡後は▲0.06~▲0.03%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、オフア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(1/31-2/3)は、▲0.165~▲0.075%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、乱高下。アウトライト市場は、3M物が▲0.138%、1Y物が▲0.169~▲0.160%出合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、600億円弱の償還総額に対して、1,100億円程度の発行総額となり、食品業態からまとまった発行が見られた。発行レートは引き続き0%を挟んだ狭いレンジでの決着が中心となっている。

## ●短期金融市場関連指標

2020/1/30	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	▲0.032				-	▲0.132	▲0.060	▲0.020	22,977.75	▲401.65	108.99-00	108.86-87
T/N							-	▲0.125						
S/N			▲0.005				-	-						
1W			▲0.035				-	▲0.108						
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.012				-	▲0.103						
3W							-	▲0.099						
1M			0.020				-	▲0.099						
3M			0.010				▲0.130	▲0.106						
6M							▲0.160	▲0.136						
1Y							▲0.169	▲0.158						
									日付	1/23	1/24	1/27	1/28	1/29
									日銀当預残	3,977,800	3,993,600	4,010,400	4,010,900	4,016,900
									準備預金残	3,455,000	3,463,600	3,481,700	3,482,800	3,488,400
									マネタリーベース	5,119,600	5,135,100	5,151,200	5,151,200	5,156,800
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.025%
									コール市場残高	111,025	103,093	97,941	103,631	100,956
									うち無担	92,013	83,595	78,501	84,423	83,852
									うちO/N	65,108	55,435	50,601	55,823	55,857
									うち有担	19,012	19,498	19,440	19,208	17,104

## ●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)
2年利付国債	409	0.10%	20,000	2020/2/3	2022/2/1	73,265.0	16,321.0	100.4950	▲0.1470%	75.9148%	100.4960	▲0.1470%	3,676.0

## ●オペ結果

種類	オフア額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2020/1/30	2020/1/31	▲0.350	330	330		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2020/1/30	2020/1/31	▲0.350	0	0				

## ●2020年1月31日の予定

*12月の完全失業率(市場予想：2.3%)	*米国12月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(885回)入札(3ヶ月、44,400億円、2/3発行)
*12月の有効求人倍率(市場予想：1.56倍)	*米国1月のシカゴPM景況感指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、2/13借入)
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.7%)	*ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値	
*12月の商業動態統計速報 *12月の住宅着工統計	*ユーロ圏10-12月期のGDP1次速報	
*1月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%)		

◆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