

Central Daily Market Report

2019年1月17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	2019年1月17日 需給速報	2019年1月18日 需給予想	2019年1月21日 当社予想
銀行券	1,500	1,400	1,000
財政	▲ 19,100	▲ 500	▲ 17,000
資金過不足	▲ 17,600	900	▲ 16,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 1,800
国債売現			
国庫短期証買入	5,000		
国債買入		4,900	
CP等買入		▲ 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			
ETF買入		300	
国債補完供給	▲ 400		400
当預増減	▲ 13,200	6,300	▲ 15,300
当座預金残高			
当座預金残高	3,864,600	3,870,900	3,855,600
準備預金残高	3,365,600		
積み終了先	3,266,200		1月18日以降の残り所要積立額
超過準備	2,839,900		積数 133,900
非準備預金先	499,000		1日平均 4,600
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額			3,140,800
準備預金進捗率	実績	95.74%	日数 6.45%

●2019年1月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.086~▲0.03%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後も▲0.08%近辺での出会いが散見される程度で本日の取引を終えた。また、本日は複数の先が試し取りを行い、0.001%でまとまった出会いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.04%近辺での出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(1/17-1/18)は▲0.200~▲0.100%程度、T/N(1/18-1/21)は▲0.170~▲0.105%程度で出会いが見られた。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10Y335~353や、5Y130~138、20Y164~166、30Y57~61、40Y11などカレント近辺の銘柄にビッドが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、低水準で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.175%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1781%、按分落札利回▲0.1741%とWI取引を反映してしっかりした結果となった。セカンダリーでは、▲0.200~▲0.194%での出会いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.180~▲0.179%で出合った。

<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1社の900億円程度の大型案件を筆頭に、複数の業態で比較のまとまった発行がみられ、償還総額700億円程度に対し、発行総額2,800億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/1/17	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.141	0.003	0.001	20,402.27	▲ 40.48	109.03-05	108.78-79
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.154						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.151						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.152						
3W							-	▲ 0.152						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.153						
3M							▲ 0.180	▲ 0.156						
6M							▲ 0.190	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.195	▲ 0.159						
									日付	1/9	1/10	1/11	1/15	1/16
									日銀当預残	3,853,500	3,862,500	3,862,000	3,861,800	3,877,800
									準備預金残	3,401,200	3,396,300	3,383,100	3,373,600	3,373,200
									マネタリーベース	4,986,500	4,992,900	4,989,900	4,987,300	5,000,500
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.062%	▲0.068%
									コール市場残高	114,480	108,152	104,196	108,711	88,274
									うち無担	84,426	83,350	78,228	83,384	74,887
									うちO/N	51,161	51,165	47,123	53,894	44,977
									うち有担	30,054	24,802	25,968	25,327	13,387

●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)
国庫短期証券	808	-	21,000	2019/1/21	2020/1/20	88,555.0	17,009.9	100.1740	▲0.1741%	90.8666%	100.1780	▲0.1781%	3,990.0

●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	2019/1/18			2,017	500	0.002		0.002	97
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2019/1/18			9,539	4312	▲0.002		0.000	2.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,143	2019/1/17	2019/1/18		345	345		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月18日の予定

*11月の石油等消費動態統計	*米国12月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(809回)入札(3ヶ月、43,400億円、1/21発行)
*12月の全国消費者物価指数(CPI)	*米国1月のミシガン大学、消費者信頼感指数速報	*流動性供給入札(6,000億円、1/21発行)
市場予想：前年比同月非(除く生鮮)+0.8%		*交付税特別会計借入(10,500億円、1/28借入)

◆本資料は信頼できるとさ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