

Central Daily Market Report

2019年1月28日(月)
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28日 需給速報	2019年1月29日 需給予想	2019年1月30日 当社予想
銀行券	600	0	0
財政	2,600	1,000	▲ 4,000
資金過不足	3,200	1,000	▲ 4,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	7,000	▲ 5,100	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	4,700	10,400	
CP等買入		▲ 400	▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			800
E T F買入	700	200	
国債補完供給		100	
当預増減	10,200	11,400	▲ 3,200
当座預金残高	3,876,700	3,888,100	3,884,900
準備預金残高	3,377,600		
積み終了先	3,376,500		1月29日以降の残り所要積立額
超過準備	3,376,500		積数
非準備預金先	499,100		1日平均
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	99.76%	日数
			41.94%

●2019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、邦銀を中心に▲0.086~▲0.03%での調達で始まった。引き続き取り急ぐような動きはみられず、一巡後は▲0.08%程度の出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T+0(1/28-1/29)は▲0.135~▲0.10%程度、T/N(1/29-1/30)は▲0.135~▲0.10%程度で出合いが見られた。前週に続いて両サイドとも厚みがあり、レートは横ばい圏での取引だった。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10Y341や、5Y126、127、129、130、131、134、40Y11などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.280~▲0.222%、1Y物が▲0.210%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は月末前倒し発行にあたり、電力・不動産業態でまとまった発行が見られた。1,400億円の償還総額に対して、発行総額は2,500億円まで膨らんだ。発行レートは0%付近での決着が中心で、変動はなかった。本日はCP等買入オベがオファー額2,500億円で実施された。結果は平均落札レート0.004%・按分落札レート▲0.001%となり、ディーラーの売却ニーズの高まりから前回(平均▲0.001%・按分▲0.002%)比で両レートとも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2019/1/28	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.108	▲ 0.005	0.000	20,649.00	▲ 124.56	109.42-43	109.40-41
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.124						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.126						
2W			▲ 0.017				-	▲ 0.126						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.130						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.280	▲ 0.155						
6M							▲ 0.200	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.158						
									日付	1/21	1/22	1/23	1/24	1/25
									日銀当預残	3,853,400	3,867,500	3,865,100	3,864,000	3,866,500
									準備預金残	3,343,300	3,363,800	3,362,600	3,365,400	3,365,900
									マネタリーベース	4,971,700	4,985,000	4,982,200	4,981,100	4,983,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.067%	▲ 0.067%	▲ 0.067%	▲ 0.066%	▲ 0.063%
									コール市場残高	92,355	93,197	97,073	99,437	96,641
									うち無担	78,351	79,473	82,821	82,776	80,872
									うちO/N	47,411	47,988	50,601	49,026	47,592
									うち有担	14,004	13,724	14,252	16,661	15,769

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	応募総額(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年超3年以下)	3,500	2019/1/29			12,233	3,507	0.004		0.004	82.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/1/29			10,129	4,008	0.000		0.001	32.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2019/1/29			4,061	2,008	0.002		0.003	84.1
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/1/29			1,387	504	0.000		0.001	55.4
CP等買入	2,500	2019/1/31			7,463	2,482	▲ 0.001		0.004	51.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,350	2019/1/28	2019/1/29		25	25		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2019年1月29日の予定

*月例経済報告	*米国FOMC(1日目)	*40年利付国債入札(4,000億円、1/30発行)
	*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、2/6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