

Central Daily Market Report

2020年1月27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	2020年1月27日		2020年1月28日		2020年1月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		500		1,000	
財政	15,400		1,500		▲7,000	
資金過不足	16,100		2,000		▲6,000	
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	7,000	▲5,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲600		▲300		
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			
国債補完供給		200				
当預増減	16,800		1,800		▲5,000	
当座預金残高	4,010,400		4,012,200		4,007,200	
準備預金残高	3,480,000					
積み終了先	3,478,800				1月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,478,800				積数	9,000
非準備預金先	530,400				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	99.72%	日数			38.71%

●2020年1月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達水準をやや引き下げる先も見られたが、引き続き調達ニーズの強い先も多く、高い水準での取引が中心となった。立ち上がりは地銀・証券業態から▲0.02~▲0.01%、信託業態から▲0.045~▲0.04%のビッド。出合いの中心は▲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(1/28-1/29)は、▲0.08~▲0.06%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、小幅低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に1Y物が▲0.145%で出合った。

<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、償還は150億円程度と少額であったが、石油・商社等からまとまった発行が見られ、発行総額は900億円強になった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2020/1/27	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	▲0.055	0.001	▲0.019				-	▲0.071	▲0.050	▲0.025	23,343.51	▲483.67	108.79-80	109.05-07
T/N							-	▲0.069						
S/N							-	-						
1W							-	▲0.071						
2W			▲0.007				-	▲0.070						
3W							-	▲0.074						
1M							-	▲0.077						
3M							▲0.120	▲0.098						
6M							▲0.135	▲0.133						
1Y							▲0.145	▲0.158						
									日付	1/20	1/21	1/22	1/23	1/24
									日銀当預残	3,965,400	3,974,200	3,971,700	3,977,800	3,993,600
									準備預金残	3,440,900	3,449,800	3,443,300	3,455,000	3,463,600
									マネタリーベース	5,109,300	5,116,600	5,113,300	5,119,600	5,135,100
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.016%
									コール市場残高	99,464	95,547	96,183	111,025	103,093
									うち無担	80,805	76,564	77,363	92,013	83,595
									うちO/N	54,215	50,224	50,913	65,108	55,435
									うち有担	18,659	18,983	18,820	19,012	19,498

●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(午前オファー分)		2020/1/27	2020/1/28	▲0.350	2	2		▲0.350	▲0.350	

●2020年1月28日の予定

*12月の企業向けサービス価格指数	*40年利付国債入札(4,000億円、1/29発行)
*FOMC(1日目)	
*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
*米国12月の耐久財新規受注	

◆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