

Central Daily Market Report

2020年1月31日(金)

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31日		2020年2月3日		2020年2月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		900		1,000	
財政	▲ 3,400		▲ 31,100		▲ 63,000	
資金過不足	▲ 2,900		▲ 30,200		▲ 62,000	
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						
CP等買入	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				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
当預増減	▲ 1,400		▲ 30,000		▲ 62,000	
当座預金残高	4,032,900		4,002,900		3,940,900	
準備預金残高	3,510,400					
積み終了先	3,510,000					
超過準備	3,510,000				2月3日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	522,500				積数 6,100	
					1日平均 500	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,236,300	
準備預金進捗率	実績	99.81%	日数	58.06%		

●2020年1月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、資金調達需要の低下傾向が続く中、月末要因も重なり、出会い水準は昨日に比べ低下した。立ち上がりは地銀業態から▲0.04~▲0.02%、信託・証券業態から▲0.07~▲0.045%のビッド。出会いの中心は▲0.065~▲0.02%のレンジとなった。一巡後は▲0.07~▲0.04%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、オフアース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(2/3-2/4)は、▲0.090~▲0.025%程度での出会い。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、上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.130~▲0.125%で出合う中、平均落札利回▲0.1257%、按分落札利回▲0.1203%と、落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.140~▲0.125%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、償還総額は400億円程であったが、鉄鋼・商社等が大ロットの発行を実施し、発行総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートに主だった変動は見られなかったが、一部銘柄で若干上昇する動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/1/31	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.093	▲ 0.065	▲ 0.005	23,205.18	227.43	108.89-90	109.03-05
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W			0.002				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.135	▲ 0.105						
6M							▲ 0.170	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.158						
									日付	1/24	1/27	1/28	1/29	1/30
									日銀当預残	3,993,600	4,010,400	4,010,900	4,016,900	4,034,300
									準備預金残	3,463,600	3,481,700	3,482,800	3,488,400	3,501,200
									マネタリーベース	5,135,100	5,151,200	5,151,200	5,156,800	5,174,000
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.025%	▲0.032%
									コール市場残高	103,093	97,941	103,631	100,956	108,859
									うち無担	83,595	78,501	84,423	83,852	91,503
									うちO/N	55,435	50,601	55,823	55,857	62,788
									うち有担	19,498	19,440	19,208	17,104	17,356

●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	885	-	44,400	2020/2/3	2020/5/7	123,527.0	36,628.40	100.0310	▲0.1203%	2.7276%	100.0324	▲0.1257%	7,771.0
交付税特会	-	-	10,500	2020/2/13	2020/8/14	236,608.0	10,500.19		0.0000%	4.4379%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/1/31	2020/2/3	▲ 0.350	169	169		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/1/31	2020/2/3	▲ 0.350	15	15		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年2月3日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国12月の建設支出
	*米国1月のISM製造業景況指数

◆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