

Central Daily Market Report

2019年12月2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12月2日		2019年12月3日		2019年12月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 28,200		▲ 23,600		▲ 81,000	
資金過不足	▲ 28,300		▲ 24,500		▲ 82,000	
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			9,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)					10,300	▲ 9,400
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入			500			
国債補完供給	▲ 200	500		200		
当預増減	▲ 28,100		▲ 14,700		▲ 81,100	
当座預金残高	4,018,500		4,003,800		3,922,700	
準備預金残高	3,500,500					
積み終了先	3,499,400				12月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,499,400				積数 4,200	
非準備預金先	518,000				1日平均 300	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					3,111,500	
準備預金進捗率	実績	99.87%	日数	56.67%		

●2019年12月2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、証券業態を中心に▲0.035~▲0.025%での調達で始まった。月末要因の剥落によりレート水準がやや上昇し、一巡後も▲0.03%近辺での出合いが見られた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02%近辺の出合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(12/3-12/4)は、▲0.050~▲0.035%程度での出合い。SCはローラー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2Y402~406、10Y336~356、5Y136~141、20Y167~170、30Y59~64、40Y9~12等にビッドの出入りが多く見られた。

＜短国市場＞

現先レート(T/N)は、上昇。アウトライト市場は、閑散ながら売りも見られ、引け際に3M物が▲0.158~▲0.150%、1Y物が▲0.201%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。発行市場は償還総額100億円程度に対して、発行は無く非常に閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2019/12/2	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.033	▲ 0.050	0.035	23,529.50	235.59	109.53-54	109.59-60
T/N							-	▲ 0.042						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.051						
2W	▲ 0.028	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.054						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.064						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.155	▲ 0.120						
6M							▲ 0.207	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.201	▲ 0.185						
									日付	11/25	11/26	11/27	11/28	11/29
									日銀当預残	4,043,300	4,051,500	4,044,100	4,046,500	4,046,600
									準備預金残	3,524,400	3,511,500	3,517,700	3,524,900	3,525,800
									マネタリーベース	5,166,000	5,174,600	5,167,900	5,172,100	5,173,300
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.018%	▲0.023%	▲0.024%	▲0.034%
									コール市場残高	89,638	110,284	96,751	98,237	96,995
									うち無担	69,492	90,662	76,469	77,628	74,923
									うちO/N	42,877	62,647	49,954	51,173	51,308
									うち有担	20,146	19,622	20,282	20,609	22,072

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/12/3			9,622	4,204	0.007		0.010	17.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/12/3			7,107	3,407	0.011		0.012	82.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/12/3			4,817	1,013	0.018		0.018	77.8
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/12/3			988	302	0.004		0.005	58.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/2	2019/12/3	-0.25	172	172		▲0.250	▲0.250	

●2019年12月3日の予定

*11月実績/12月見込み財政資金対民間収支 *11月のマネタリーベース	*10年利付国債入札 (21,000億円、12/4発行)
---	---------------------------------

◆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