

Central Daily Market Report

2019年12月4日(水)

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4日		2019年12月5日		2019年12月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 2,100		▲ 2,000	
財政	▲ 81,400		600		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 82,100		▲ 1,500		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 500	3,000	
貸出支援基金(成)	10,300	▲ 5,400				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入	100					
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 76,300		▲ 1,800		▲ 3,000	
当座預金残高	3,923,700		3,921,900		3,918,900	
準備預金残高	3,411,000					
積み終了先	3,410,700				12月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,410,700				積数 2,600	
非準備預金先	512,700				1日平均 200	
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	99.92%	日数	63.33%		

●2019年12月4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▲0.03~▲0.01%での調達で始まった。法人税・年金保険料揚げによる大幅な資金不足日であったため、昨日よりも調達レートが上昇した。一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、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/N(12/5-12/6)は、▲0.050~▲0.040%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.150%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と発行超であった。一部の機械業態において大型発行が見られたものの、案件数はあまり膨らまず落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/12/4	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.049	▲ 0.040	▲ 0.015	23,135.23	▲ 244.58	108.67-68	108.47-48
T/N							-	▲ 0.050						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.054						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.059						
3W							-	▲ 0.068						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.150	▲ 0.120						
6M							▲ 0.207	▲ 0.166						
1Y							▲ 0.201	▲ 0.185						
									日付	11/27	11/28	11/29	12/2	12/3
									日銀当預残	4,044,100	4,046,500	4,046,600	4,018,500	4,000,000
									準備預金残	3,517,700	3,524,900	3,525,800	3,501,400	3,473,800
									マネタリーベース	5,167,900	5,172,100	5,173,300	5,145,400	5,127,800
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.024%	▲0.034%	▲0.031%	▲0.028%
									コール市場残高	96,751	98,237	96,995	93,651	91,581
									うち無担	76,469	77,628	74,923	71,960	71,011
									うちO/N	49,954	51,173	51,308	49,270	47,751
									うち有担	20,282	20,609	22,072	21,691	20,570

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2019/12/13	2020/6/12	306,820.0	10,500.18		0.0000%	3.4223%		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)		2019/12/4	2019/12/5	▲ 0.350	276	276		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/4	2019/12/5	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2019年12月5日の予定

*原田日銀審議委員、大分県金融経済懇談会において講演	*米国10月の貿易収支 *米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫 *ユーロ圏7-9月期のGDP確報値	*30年利付国債入札 (7,000億円、12/6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