

Central Daily Market Report

2019年12月5日(木)

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5日		2019年12月6日		2019年12月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 1,800		▲ 1,000	
財政	600		▲ 6,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 8,500		▲ 3,000	
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						▲ 6,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500	3,000	▲ 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		▲ 100		▲ 100		
ETF買入			600			
国債補完供給	▲ 900	300		900		
当預増減	▲ 2,700		▲ 4,400		▲ 9,200	
当座預金残高	3,921,000		3,916,600		3,907,400	
準備預金残高	3,410,500					
積み終了先	3,410,200					
超過準備					12月6日以降の残り所要積立額 積数 2,300	
非準備預金先	510,500				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		99.93%		日数 66.67%	

●2019年12月5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▲0.025~▲0.01%での調達で始まった。昨日に続き調達ニーズが強く、一巡後も▲0.01%近辺での出合いが見られた。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(12/6-12/9)は、▲0.050~▲0.025%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▲0.145%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2,000億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と発行超であった。複数業態において大型発行が見られたため、活況なマーケットとなった。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

2019/12/5	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.038	▲ 0.045	▲ 0.005	23,300.09	164.86	108.83-84	108.88-90
T/N							-	▲ 0.032						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.043						
2W							-	▲ 0.049						
3W							-	▲ 0.064						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.145	▲ 0.114						
6M							▲ 0.206	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.185						
									日付	11/28	11/29	12/2	12/3	12/4
									日銀当預残	4,046,500	4,046,600	4,018,500	4,000,000	3,923,700
									準備預金残	3,524,900	3,525,800	3,501,400	3,473,800	3,412,600
									マネタリーベース	5,172,100	5,173,300	5,145,400	5,127,800	5,052,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.024%	▲ 0.034%	▲ 0.031%	▲ 0.028%	▲ 0.025%
									コール市場残高	98,237	96,995	93,651	91,581	92,936
									うち無担	77,628	74,923	71,960	71,011	72,947
									うちO/N	51,173	51,308	49,270	47,751	49,047
									うち有担	20,609	22,072	21,691	20,570	19,989

●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)
30年利付国債	64	0.40%	7,000	2019/12/6	2049/9/20	21,087.0	5,716.0	99.1500	0.4320%	88.7986%	99.2000	0.4300%	1,280.0

●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)		2019/12/5	2019/12/6	▲ 0.250	357	357		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/5	2019/12/6	▲ 0.250	511	511		▲ 0.250	▲ 0.250	

●2019年12月6日の予定

- *10月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲3.0%)
- *10月の毎月勤労統計調査速報
- *10月の景気動向指数速報
- *11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国10月の卸売売上高
- *米国10月の消費者信用残高
- *米国11月の雇用統計
- *米国12月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *国庫短期証券(874回)入札 (3ヶ月、43,200億円、12/9発行)

◆本資料は信頼できるとさ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