

Central Daily Market Report

2019年12月6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	2019年12月6日		2019年12月9日		2019年12月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 700		▲ 1,000	
財政	▲ 6,000		▲ 2,700		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 7,800		▲ 3,400		▲ 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			5,800	▲ 6,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,900			
CP等買入	3,000	▲ 300		▲ 100		
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		▲ 300		
E T F 買入	600					
国債補完供給	▲ 600	900		600		
当預増減	▲ 4,300		8,300		▲ 6,000	
当座預金残高	3,916,700		3,925,000		3,919,000	
準備預金残高	3,399,300					
積み終了先	3,399,100					
超過準備	3,399,100				12月9日以降の残り所要積立額 積数 1,400	
非準備預金先	517,400				1日平均 200	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額						3,117,600
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	76.67%		

●2019年12月6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▲0.01~▲0.005%での調達が始まった。週末3日積みの取引となることから、調達ニーズはさらに強まり、レート水準が上昇した。一巡後も強めの地合いは継続し、▲0.005%近辺の出合いが数件見られた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは30,000億円(12/9-12/10)、15,000億円(12/9-12/27)の2本がオファーされ、12/10エンド分は応れなし、12/27エンド分は応れ額5,757億円(期落ち分6,216億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(12/9-12/10)は、▲0.035~▲0.015%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2Y402~406、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、発行日要因もあってか、上昇した。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▲0.1425~▲0.135%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1187%、按分落札利回▲0.0986%と、テールが大きく流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでも、▲0.1075~▲0.095%と軟調な推移となった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は発行・償還総額共に4,500億円程度と横ばいで推移した。5・10日発行となり鉄鋼・その他金融業態において大型案件が見られ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

2019/12/6	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.035	▲ 0.019	0.026	23,354.40	54.31	108.72-74	108.66-67
T/N							-	▲ 0.032						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.002	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.039						
2W							-	▲ 0.051						
3W							-	▲ 0.066						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.107	▲ 0.111						
6M							▲ 0.185	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.199	▲ 0.184						
									日付	11/29	12/2	12/3	12/4	12/5
									日銀当預残	4,046,600	4,018,500	4,000,000	3,923,700	3,921,000
									準備預金残	3,525,800	3,501,400	3,473,800	3,412,600	3,411,600
									マネタリーベース	5,173,300	5,145,400	5,127,800	5,052,200	5,051,600
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.031%	▲0.028%	▲0.025%	▲0.017%
									コール市場残高	96,995	93,651	91,581	92,936	94,229
									うち無担	74,923	71,960	71,011	72,947	74,233
									うちO/N	51,308	49,270	47,751	49,047	50,188
									うち有担	22,072	21,691	20,570	19,989	19,996

●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	874	-	43,200	2019/12/9	2020/3/16	100,431.0	35,270.9	100.0265	▲0.0986%	47.7217%	100.0319	▲0.1187%	7,929.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	30,000	2019/12/9	2019/12/10		0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	15,000	2019/12/9	2019/12/27		5,757	5,757				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/12/9			10,182	4,204	0.012		0.014	71.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/12/9			11,151	3,402	0.018		0.019	72.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/12/9			8,979	3,503	0.018		0.019	82.0
国債買入(物価連動債)	300	2019/12/9			1,483	304	▲0.080		▲0.112	65.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/6	2019/12/9	▲0.250	421	421		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/6	2019/12/9	▲0.250	138	138		▲0.250	▲0.250	

●2019年12月9日の予定

*7-9月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+0.7%)	*国庫短期証券(875回)入札(6ヶ月、23,000億円、12/10発行)
*10月の国際収支	
*11月の景気ウォッチャー調査	

◆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