

# Central Daily Market Report

2019年12月9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9日		2019年12月10日		2019年12月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,600		▲ 2,000	
財政	▲ 1,300		▲ 3,000		▲ 19,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 4,600		▲ 21,000	
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		3,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入		▲ 300				
E T F 買入			200			
国債補完供給		600				
当預増減	9,600		▲ 1,900		▲ 21,000	
当座預金残高	3,926,300		3,924,400		3,903,400	
準備預金残高	3,410,100					
積み終了先	3,409,900					
超過準備	3,409,900					
非準備預金先	516,200					
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	80.00%		

## ●2019年12月9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%での調達で始まった。引き続き強めの地合いは変わらず、一巡後も▲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。

### <レポ市場>

GC T/N(12/10-12/11)は、▲0.025~▲0.01%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2Y402~407、10Y335~356、5Y136~141、20Y167~170、30Y59~64、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、上昇した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.110~▲0.105%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1036%、按分落札利回▲0.0996%と、先週末の3M物の入札同様、非常に弱い結果となった。しかし、結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.119~▲0.105%と堅調に推移した。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は案件少なく、償還総額380億円程度に対して、発行総額は230億円程度と償還超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/9	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.024	▲ 0.010	0.009	23,430.70	76.30	108.63-64	108.56-57
T/N							-	▲ 0.017						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.007	▲ 0.017				-	▲ 0.031						
2W			0.000				-	▲ 0.048						
3W							-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.107	▲ 0.104						
6M							▲ 0.115	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.184						
									日付	12/2	12/3	12/4	12/5	12/6
									日銀当預残	4,018,500	4,000,000	3,923,700	3,921,000	3,916,700
									準備預金残	3,501,400	3,473,800	3,412,600	3,411,600	3,399,300
									マネタリーベース	5,145,400	5,127,800	5,052,200	5,051,600	5,049,200
									無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.028%	▲0.025%	▲0.017%	▲0.009%
									コール市場残高	93,651	91,581	92,936	94,229	93,923
									うち無担	71,960	71,011	72,947	74,233	74,411
									うちO/N	49,270	47,751	49,047	50,188	51,576
									うち有担	21,691	20,570	19,989	19,996	19,512

## ●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	875	-	23,000	2019/12/10	2020/6/10	87,498.0	19,834.5	100.0500	▲0.0996%	69.6808%	100.0520	▲0.1036%	3,165.0

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2019/12/10			1,267	501	0.013		0.043	80.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/12/10			2,973	1,005	0.008		0.010	16.2
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/12/10			1,026	304	0.010		0.011	33.5
国債買入(変動利付債)	1,000	2019/12/10			3,564	1,001	▲0.240		▲0.254	25.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/9	2019/12/10	▲0.250	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/9	2019/12/10	▲0.250	27	27		▲0.250	▲0.250	

## ●2019年12月10日の予定

*10月の特定サービス産業動態統計速報	*米国FOMC(1日目)	*5年利付国債入札(19,000億円、12/11発行)
*11月のマネーストック		*エネルギー対策借入(6,000億円、12/20借入)

◆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