

# Central Daily Market Report

2019年12月10日(火)

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10日		2019年12月11日		2019年12月12日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 1,600	▲ 1,700	▲ 1,700	▲ 1,700	▲ 2,000	▲ 2,000
財政	▲ 6,900	▲ 23,100	▲ 23,100	▲ 23,100	▲ 2,000	▲ 2,000
資金過不足	▲ 8,500	▲ 24,800	▲ 24,800	▲ 24,800	▲ 0	▲ 0
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	3,000					
CP等買入		▲ 500		▲ 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						
E T F 買入	200					
国債補完供給	▲ 200			200		
当預増減	▲ 6,000		▲ 24,900			0
当座預金残高	3,920,300		3,895,400		3,895,400	
準備預金残高	3,416,500					
積み終了先	3,416,200					
超過準備	3,416,200					
非準備預金先	503,800					
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	99.97%	日数	83.33%		

## ●2019年12月10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。一巡後も強めの地合いは継続し、▲0.005%近辺の出合いが見られた。ターム物に関しては、12/16スタートの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(12/11-12/12)は、▲0.02～0.00%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、発行日要因もあってか、上昇した。アウトライト市場は、3M物が▲0.110～▲0.105%、6M物が▲0.119～▲0.115%、1Y物が▲0.188～▲0.185%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は複数業態で大型発行が見られ、償還総額950億円程度に対して、発行総額は3,800億円程度と発行超となった。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

2019/12/10	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.008				-	▲ 0.018	▲ 0.025	▲ 0.015	23,410.19	▲ 20.51	108.58-60	108.62-63
T/N							-	▲ 0.017						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.032						
2W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.050						
3W							-	▲ 0.086						
1M							-	▲ 0.089						
3M							▲ 0.110	▲ 0.102						
6M							▲ 0.119	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.185	▲ 0.181						
									日付	12/3	12/4	12/5	12/6	12/9
									日銀当預残	4,000,000	3,923,700	3,921,000	3,916,700	3,926,300
									準備預金残	3,473,800	3,412,600	3,411,600	3,399,300	3,410,800
									マネタリーベース	5,127,800	5,052,200	5,051,600	5,049,200	5,059,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.025%	▲ 0.017%	▲ 0.009%	▲ 0.008%
									コール市場残高	91,581	92,936	94,229	93,923	91,242
									うち無担	71,011	72,947	74,233	74,411	71,372
									うちO/N	47,751	49,047	50,188	51,576	49,102
									うち有担	20,570	19,989	19,996	19,512	19,870

## ●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)
5年利付国債	141	0.10%	19,000	2019/12/11	2024/9/20	62,558.0	15,554.00	100.8000	▲0.0660%	43.9215%	100.8800	▲0.0830%	3,441.0
エネルギー対策	-	-	6,000	2019/12/20	2020/12/21	124,510.0	5,999.92		0.0000%	4.8189%		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)		2019/12/10	2019/12/11	▲ 0.250	92	92		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/10	2019/12/11	▲ 0.250	110	110		▲ 0.250	▲ 0.250	
米ドル資金供給		2019/12/12	2019/12/19	2.050	2	2				

## ●2019年12月11日の予定

*10-12月期の法人企業景気予測調査季報	*米国FOMC(2日目)
*11月の企業物価指数	*米国FRB経済見通し発表
	*米国11月の財政収支
	*米国11月の消費者物価指数

◆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