

Central Daily Market Report

2019年12月11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11日		2019年12月12日		2019年12月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 3,300		▲ 3,000	
財政	▲ 22,800		3,100		66,000	
資金過不足	▲ 24,600		▲ 200		63,000	
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			2,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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		
E T F 買入						
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 24,700		1,400		63,000	
当座預金残高	3,895,600		3,897,000		3,960,000	
準備預金残高	3,391,600					
積み終了先	3,391,400				12月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,391,400				積数 700	
非準備預金先	504,000				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	99.98%	日数	86.67%		

●2019年12月11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。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も朝方と横ばい圏のレートで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▲0.03%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(12-12/13)は、▲0.01~0.00%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場では、短国買入オペが2,000億円(前回から1,000億円増額)でオファーされた。平均落札利回較差+0.052%、按分落札利回較差+0.041%と、在庫調整の売りからか、弱めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.140~▲0.1175%、6M物が▲0.122~▲0.117%、1Y物が▲0.180%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は機械業態で大型発行が見られ、償還総額2,000億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と若干の発行超となった。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

2019/12/11	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.008	▲ 0.005	0.020	23,391.86	▲ 18.33	108.77-78	108.72-73
T/N							-	▲ 0.006						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.030						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.056						
3W							-	▲ 0.084						
1M							-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.140	▲ 0.103						
6M							▲ 0.121	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.182						
									日付	12/4	12/5	12/6	12/9	12/10
									日銀当預残	3,923,700	3,921,000	3,916,700	3,926,300	3,920,300
									準備預金残	3,412,600	3,411,600	3,399,300	3,410,800	3,416,500
									マネタリーベース	5,052,200	5,051,600	5,049,200	5,059,500	5,055,200
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.017%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.008%
									コール市場残高	92,936	94,229	93,923	91,242	96,116
									うち無担	72,947	74,233	74,411	71,372	76,810
									うちO/N	49,047	50,188	51,576	49,102	54,560
									うち有担	19,989	19,996	19,512	19,870	19,306

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国庫短期証券買入	2,000	2019/12/12			10,191	2,000	0.041		0.052	36.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/11	2019/12/12	▲0.250	11	11		▲0.250	▲0.250	

●2019年12月12日の予定

*雨宮日銀副総裁、岡山県金融経済懇談会において講演	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*流動性供給入札(5,000億円、12/13発行)
*10月の機械受注統計(市場予想:船舶、電力除く民需、前月比+0.9%)	*米国11月の生産者物価指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、12/20借入)

◆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