

Central Daily Market Report

2019年12月12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12日		2019年12月13日		2019年12月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,300		▲ 2,700		▲ 2,000	
財政	2,500		70,000		5,000	
資金過不足	▲ 800		67,300		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						
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		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					20,600	▲ 20,000
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	700		66,900		3,600	
当座預金残高	3,896,300		3,963,200		3,966,800	
準備預金残高	3,381,500					
積み終了先	3,381,300					
超過準備	3,381,300					
非準備預金先	514,800					
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	99.98%	日数	90.00%		

●2019年12月12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。積み最終日を前に引き続き調達意欲は強く、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＞

GCT/N(12/13-12/16)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等にビッグの出入りがあった。

＜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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.135～▲0.130%、6M物が▲0.130～▲0.129%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は複数の業態で大型発行が見られたものの、減額ロールが散見され、償還総額3,500億円程度に対して、発行総額は2,800億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

2019/12/12	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.003	▲ 0.025	▲ 0.020	23,424.81	32.95	108.55-56	108.64-65
T/N							-	▲ 0.003						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.031						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.062						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.140	▲ 0.103						
6M							▲ 0.129	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.182						
									日付	12/5	12/6	12/9	12/10	12/11
									日銀当預残	3,921,000	3,916,700	3,926,300	3,920,300	3,895,600
									準備預金残	3,411,600	3,399,300	3,410,800	3,416,500	3,391,600
									マネタリーベース	5,051,600	5,049,200	5,059,500	5,055,200	5,032,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.008%
									コール市場残高	94,229	93,923	91,242	96,116	91,551
									うち無担	74,233	74,411	71,372	76,810	72,595
									うちO/N	50,188	51,576	49,102	54,560	49,785
									うち有担	19,996	19,512	19,870	19,306	18,956

●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)
流動性供給	299	-	5,000	2019/12/13		12,804.0	4,991.0		0.0000%	55.1801%		▲ 0.0050%	
交付税特会	-	-	10,500	2019/12/20	2020/6/19	298,431.0	10,500.17		0.0000%	3.5185%		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)		2019/12/12	2019/12/13	▲ 0.250	105	105		▲ 0.250	▲ 0.250	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2019/12/16	2023/12/15	0	20,601

●2019年12月13日の予定

*12月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国10月の企業在庫 *米国11月の小売売上高	*国庫短期証券(876回)入札 (3ヶ月、43,200億円、12/16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お客様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