

# Central Daily Market Report

2019年12月13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13日		2019年12月16日		2019年12月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,800		▲ 1,600		▲ 3,000	
財政	70,200		1,600		1,000	
資金過不足	67,400		0		▲ 2,000	
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						
国債買入			11,900			
CP等買入		▲ 500		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			20,600	▲ 17,600		
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	66,900		14,600		▲ 2,000	
当座預金残高	3,963,200		3,977,800		3,975,800	
準備預金残高	3,442,400					
積み終了先	3,442,400				12月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,442,200				積数 3,227,400	
非準備預金先	520,800				1日平均 104,100	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,227,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%		日数	0.00%	

## ●2019年12月13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。年金定時払いで大幅な資金余剰日であるものの、積み最終日ということもあって、引き続き着地に向けた調整の調達ニーズが強く、一巡後も朝方と横ばい圏のレートでの出会いが見られた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02%近辺の出会いが散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(12/16-12/17)は、▲0.105～▲0.08%程度での出会い。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、新積み期に入ったこともあってか、レートが低下した。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▲0.135～▲0.126%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1284%、按分落札利回▲0.1154%と、前回債からレートが低下し、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.170～▲0.140%と強含みでの推移となった。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。CP発行市場はノンバンクや食料品業態で大型発行があったものの案件が少なく、償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は760億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。本日はCP等買入オペアが、予定額より500億円少ない2,500億円でオフアされた。平均落札レート0%、按分レート▲0.001%と、前回比(平均0.005%、按分▲0.001%)で平均レートのみ低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/13	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				-	▲ 0.020	▲ 0.025	0.000	24,023.10	598.29	109.39-41	109.62-63
T/N							-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.097						
2W			▲ 0.023				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.160	▲ 0.113						
6M							▲ 0.151	▲ 0.158						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.181						
									日付	12/6	12/9	12/10	12/11	12/12
									日銀当預残	3,916,700	3,926,300	3,920,300	3,895,600	3,896,300
									準備預金残	3,399,300	3,410,800	3,416,500	3,391,600	3,381,600
									マネタリーベース	5,049,200	5,059,500	5,055,200	5,032,300	5,036,300
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.009%
									コール市場残高	93,923	91,242	96,116	91,551	88,250
									うち無担	74,411	71,372	76,810	72,595	69,399
									うちO/N	51,576	49,102	54,560	49,785	46,489
									うち有担	19,512	19,870	19,306	18,956	18,851

## ●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	876	-	43,200	2019/12/16	2020/3/23	146,705.0	35,275.4	100.0310	▲0.1154%	0.9973%	100.0345	▲0.1284%	7,924.0

## ●オペア結果

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年超3年以下)	4,200	2019/12/16			7,413	4,207	0.006		0.010	36.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/12/16			7,443	3,404	0.005		0.008	3.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/12/16			6,669	3,509	0.008		0.011	88.0
国債買入(物価連動債)	300	2019/12/16			1,372	302	▲0.110		▲0.139	82.8
CP等買入	2,500	2019/12/18			8,405	2,473	▲0.001		0.000	28.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/13	2019/12/16	▲0.250	101	101		▲0.250	▲0.250	

## ●2019年12月16日の予定

- \*10月の第3次産業活動指数
- \*10月の石油等消費動態統計

◆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