

# Central Daily Market Report

2019年12月16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16日		2019年12月17日		2019年12月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 2,300		▲ 3,000	
財政	1,500		1,300		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 200		▲ 1,000		▲ 12,000	
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		▲ 200	2,500	
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	14,300		▲ 1,100		▲ 9,500	
当座預金残高	3,977,500		3,976,400		3,966,900	
準備預金残高	3,462,900					
積み終了先	2,147,900					
超過準備	870,200				12月17日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	514,600				積数 634,700	
					1日平均 21,200	
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	80.33%	日数	3.23%		

## ●2019年12月16日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.080～▲0.035%の出会いが中心となった。新積み期に入ったことから先週末までの過熱感は剥落し、レートは低下。O/Nの下限域にあたる▲0.080%台後半での出会いも一部見られていた。ターム物に関しては年内エンドのショートターム物で出会いが散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(12/17-12/18)は、▲0.10～▲0.09%程度での出会い。SCはローラー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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.155%、6M物が▲0.160～▲0.158%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。発行市場は石油・石炭製品業態でまとまった額の調達のみ見られたものの、発行案件は膨らまず、償還総額1,500億円程度に対し、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートについては、引き続き0%近辺の狭いレンジで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/16	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.089	▲ 0.030	▲ 0.005	23,952.35	▲ 70.75	109.38-40	109.40-41
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.035	▲ 0.029	▲ 0.031				-	▲ 0.110						
3W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.111						
1M			▲ 0.050				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.160	▲ 0.114						
6M							▲ 0.158	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.181						
									日付	12/9	12/10	12/11	12/12	12/13
									日銀当預残	3,926,300	3,920,300	3,895,600	3,896,300	3,963,200
									準備預金残	3,410,800	3,416,500	3,391,600	3,381,600	3,442,900
									マネタリーベース	5,059,500	5,055,200	5,032,300	5,036,300	5,106,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.009%	▲ 0.008%
									コール市場残高	91,242	96,116	91,551	88,250	79,421
									うち無担	71,372	76,810	72,595	69,399	60,202
									うちO/N	49,102	54,560	49,785	46,489	39,142
									うち有担	19,870	19,306	18,956	18,851	19,219

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/16	2019/12/17	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/16	2019/12/17	▲ 0.350	48	48		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年12月17日の予定

*米国11月の住宅着工件数	*20年利付国債入札
*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率	(9,000億円、12/18発行)

◆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