

# Central Daily Market Report

2019年12月17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17日		2019年12月18日		2019年12月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,300		▲ 2,500		▲ 4,000	
財政	▲ 400		▲ 10,800		2,000	
資金過不足	▲ 2,700		▲ 13,300		▲ 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			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200	2,500	▲ 100		
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						
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	▲ 3,000		▲ 9,700		▲ 2,000	
当座預金残高	3,974,500		3,964,800		3,962,800	
準備預金残高	3,454,600					
積み終了先	3,358,100				12月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,921,500				積数 105.900	
非準備預金先	519,900				1日平均 3.700	
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	96.72%	日数	6.45%		

## ●2019年12月17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▲0.087~▲0.040%の出会いが中心となった。一巡後は調整から▲0.070~▲0.045%程度で散発的な出会いが見られていた。ターム物に関しては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(12/18-12/19)は、▲0.095~▲0.090%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場では、短国買入オペが1,000億円(前回比▲1,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.025%、按分落札利回較差+0.022%と、在庫調整の売りからか、小甘い結果となった。マーケットでは、引け際に3M物が▲0.165~▲0.160%、6M物が▲0.158~▲0.150%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は小型の案件が多く、発行総額は500億円程度と、償還総額の1,400億円程度を下回った。発行レートについては、横ばい圏で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/17	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.090	▲ 0.015	0.015	24,066.12	113.77	109.57-59	109.59-60
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.110						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.165	▲ 0.115						
6M							▲ 0.155	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.182						
									日付	12/10	12/11	12/12	12/13	12/16
									日銀当預残	3,920,300	3,895,600	3,896,300	3,963,200	3,977,500
									準備預金残	3,416,500	3,391,600	3,381,600	3,442,900	3,463,200
									マネタリーベース	5,055,200	5,032,300	5,036,300	5,106,000	5,122,100
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.008%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.053%
									コール市場残高	96,116	91,551	88,250	79,421	105,082
									うち無担	76,810	72,595	69,399	60,202	82,865
									うちO/N	54,560	49,785	46,489	39,142	57,790
									うち有担	19,306	18,956	18,851	19,219	22,217

## ●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)
20年利付国債	170	0.30%	9,000	2019/12/18	2039/9/20	30,269.0	7,374.0	100.2000	0.2890%	30.5611%	100.2500	0.2860%	1,620.0

## ●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	1,000	2019/12/18			7,583	1,000	0.022		0.025	21.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/17	2019/12/18	▲ 0.350	226	226		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/12/19	2019/12/27	2.040	1	1				

## ●2019年12月18日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目)	*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(877回)入札(1年、19,000億円、12/20発行)
*11月の貿易統計	*英国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