

Central Daily Market Report

2019年12月18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18日		2019年12月19日		2019年12月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,500		▲ 3,900		▲ 5,000	
財政	▲ 13,500		2,600		82,000	
資金過不足	▲ 16,000		▲ 1,300		77,000	
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			11,300			
CP等買入	2,500	▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 100
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 12,500		9,900		77,000	
当座預金残高	3,962,000		3,971,900		4,048,900	
準備預金残高	3,448,900					
積み終了先	3,419,900					
超過準備	3,387,100					
非準備預金先	513,100					
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	98.63%	日数	9.68%		

●2019年12月18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。概ね幅広い圏で推移し、出会い一巡後は調整から▲0.087%の出会いが見られた程度であった。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(12/19-12/20)は、▲0.100~▲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、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.125~▲0.115%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1172%、按分落札利回▲0.1053%と、需給環境を反映してか、前回債からレートが上昇する弱めの結果となった。一方、結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.124~▲0.110%出会いと堅調に推移した。この他に6M物が▲0.150%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行となり、鉄鋼、石油・石炭製品、機械等複数業態でまとまった額の調達が行われたものの、発行総額は4,000億円程度と償還総額の7,000億円程度を下回った。発行レートについては、発行残高が積み上がっている銘柄や期内物で僅かに上昇したが、全般的には横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/12/18	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	0.003	▲ 0.060				-	▲ 0.092	▲ 0.020	▲ 0.005	23,934.43	▲ 131.69	109.52-53	109.43-45
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.020				-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.165	▲ 0.115						
6M							▲ 0.155	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.180						
									日付	12/11	12/12	12/13	12/16	12/17
									日銀当預残	3,895,600	3,896,300	3,963,200	3,977,500	3,974,500
									準備預金残	3,391,600	3,381,600	3,442,900	3,463,200	3,454,400
									マネタリーベース	5,032,300	5,036,300	5,106,000	5,122,100	5,121,300
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.053%	▲0.057%
									コール市場残高	91,551	88,250	79,421	105,082	104,002
									うち無担	72,595	69,399	60,202	82,865	82,098
									うちO/N	49,785	46,489	39,142	57,790	56,073
									うち有担	18,956	18,851	19,219	22,217	21,904

●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	877	-	19,000	2019/12/20	2020/12/21	65,783.0	16,178.8	100.1060	▲0.1053%	66.2745%	100.1180	▲0.1172%	2,821.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/12/19			6,798	4,206	▲0.003		▲0.001	52.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/12/19			8,367	3,407	▲0.003		▲0.003	53.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/12/19			7,801	3,504	▲0.004		▲0.003	97.3
社債等買入	750	2019/12/24			2,852	750	0.050		0.058	83.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/18	2019/12/19	-0.35	119	119		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第104回	2019/12/20	2020/12/18	0	71
被災地金融支援オペ(熊本)	第43回	2019/12/20	2020/12/18	0	0

●2019年12月19日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*英中銀MPC結果発表
*黒田日銀総裁定例会見	*米国11月の米中古住宅販売

◆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