

# Central Daily Market Report

2019年12月23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23日		2019年12月24日		2019年12月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,000		▲ 3,400		▲ 4,000	
財政	▲ 14,400		▲ 1,200		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 17,400		▲ 4,600		▲ 5,000	
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				800		
E T F 買入				500		
国債補完供給	▲ 1,000	1,200		1,000		
当預増減	▲ 17,500		▲ 2,500		▲ 5,000	
当座預金残高	4,025,200		4,022,700		4,017,700	
準備預金残高	3,497,900					
積み終了先	3,496,600					
超過準備	3,496,600				12月24日以降の残り所要積立額 積数 13,500	
非準備預金先	527,300				1日平均 600	
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	99.58%	日数	25.81%		

## ●2019年12月23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▲0.087～▲0.050%程度で調整の出会いが見られるのみだった。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(12/24-12/25)は、▲0.065～▲0.050%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、横ばいから若干低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.110%、6M物が▲0.145%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、2,800億円程度の償還に対して、1,800億円程度の発行となる償還超であったが、ノンバンク、商社等から大口発行が実施された。発行レートは引き続き0%付近の決着が中心となっている。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/23	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	▲ 0.059				-	▲ 0.064	0.000	▲ 0.005	23,821.11	4.48	109.49-51	109.39-40
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.037				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.082						
1M							-	▲ 0.085						
3M							▲ 0.110	▲ 0.098						
6M							▲ 0.145	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.118	▲ 0.170						
									日付	12/16	12/17	12/18	12/19	12/20
									日銀当預残	3,977,500	3,974,500	3,962,000	3,969,000	4,042,700
									準備預金残	3,463,200	3,454,400	3,449,600	3,449,300	3,521,500
									マネタリーベース	5,122,100	5,121,300	5,111,400	5,122,300	5,199,200
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.057%	▲0.060%	▲0.061%	▲0.061%
									コール市場残高	105,082	104,002	107,129	108,584	115,031
									うち無担	82,865	82,098	85,051	84,758	87,556
									うちO/N	57,790	56,073	58,231	56,818	58,071
									うち有担	22,217	21,904	22,078	23,826	27,475

## ●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)		2019/12/23	2019/12/24	▲ 0.350	804	804		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/23	2019/12/24	▲ 0.350	151	151		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2019年12月24日の予定

*クリスマスイブ	*EURO祝日(Christmas Eve)	*2年利付国債入札(20,000億円、2020/1/6発行)
*日銀金融政策決定会合議事要旨(10月30-31日分)		

◆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