

Central Daily Market Report

2019年12月24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24日		2019年12月25日		2019年12月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,600		▲ 3,600		▲ 4,000	
財政	▲ 100		▲ 3,000		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 3,700		▲ 6,600		▲ 6,000	
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			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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			▲ 200		
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 100	1,000		100		
当預増減	▲ 1,700		▲ 1,900		▲ 6,000	
当座預金残高	4,023,500		4,021,600		4,015,600	
準備預金残高	3,498,000					
積み終了先	3,497,000				12月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,497,000				積数 12,500	
非準備預金先	525,500				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	99.61%	日数	29.03%		

●2019年12月24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▲0.075~▲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(12/25-12/26)は、▲0.075~▲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、横ばい圏で推移。アウトライト市場では、短国買入オペが市場予想より多い5,000億円(前回は+4,000億円)でオファーされた。マーケットでは、オペ通告前には、6M物が▲0.115%と前日対比で3毛甘の売り水準で出合った。一方、オペ通告後には、1Y物で▲0.120%と前日対比で2糸強の買い水準での出会いが見られた。応札額も1兆5,958億円と多く、平均落札利回較差+0.038%、按分落札利回較差+0.022%と、非常に弱い結果となった。

<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、償還総額は500億円弱であったものの、小売・石油業態等から大口発行が見られたほか幅広い先が発行を行い、発行総額は2,900億円程度に膨らんだ。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2019/12/24	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.058				-	▲ 0.068	0.000	0.000	23,830.58	9.47	109.39-40	109.39-40		
T/N							-	▲ 0.072								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.087								
2W							-	▲ 0.085								
3W							-	▲ 0.083								
1M							-	▲ 0.084								
3M							▲ 0.110	▲ 0.100								
6M							▲ 0.145	▲ 0.150								
1Y							▲ 0.120	▲ 0.169								
											日付	12/17	12/18	12/19	12/20	12/23
											日銀当預残	3,974,500	3,962,000	3,969,000	4,042,700	4,025,200
											準備預金残	3,454,400	3,449,600	3,449,300	3,521,500	3,498,600
											マネタリーベース	5,121,300	5,111,400	5,122,300	5,199,200	5,184,700
											無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.060%	▲0.061%	▲0.061%	▲0.059%
											コール市場残高	104,002	107,129	108,584	115,031	106,541
											うち無担	82,098	85,051	84,758	87,556	83,620
											うちO/N	56,073	58,231	56,818	58,071	52,365
											うち有担	21,904	22,078	23,826	27,475	22,921

●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)
2年利付国債	408	0.10%	20,000	2020/1/6	2022/1/1	77,629.0	16,560.0	100.3900	▲0.0950%	52.9179%	100.3950	▲0.0980%	3,435.0

●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	5,000	2019/12/25			15,958	5,000	0.022		0.038	40.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/24	2019/12/25	▲ 0.350	40	40		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2019/12/24	2019/12/25	▲ 0.350	38	38		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2019/12/27	2020/1/9	2.070	0	0				

●2019年12月25日の予定

*クリスマス	*New York、EURO、London祝日(Christmas Day)
*11月の企業向けサービス価格指数	

◆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