

Central Daily Market Report

2019年12月26日(木)

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26日		2019年12月27日		2019年12月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 5,100		▲ 4,100		▲ 600	
財政	200		▲ 2,500		▲ 700	
資金過不足	▲ 4,900		▲ 6,600		▲ 1,300	
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			6,000	▲ 5,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,700					
CP等買入		▲ 400		▲ 1,300	2,500	
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						
当預増減		400		▲ 7,700		1,200
当座預金残高		4,022,200		4,014,500		4,015,700
準備預金残高		3,509,400				
積み終了先		3,509,000				
超過準備					12月27日以降の残り所要積立額 積数	11,400
非準備預金先		512,800			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	99.65%	日数		35.48%

●2019年12月26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~▲0.035%の出会いが中心となった。一巡後は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(12/27-12/30)は、▲0.06~▲0.05%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、引け際に1Y物が▲0.123%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は二営業日後が年末発行にあたり、幅広い業態から入札が実施された。商社・鉄鋼・電力業態等から大型案件が見られたが、2兆4,300億円程度の償還総額に対して、入札ベースの発行総額は、前倒し発行分も含め1兆300億円程度と例年通り大幅な償還超となった。発行レートは、引き続き0%近辺での決着が中心となっている。

●短期金融市場関連指標

2019/12/26	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	▲ 0.055				-	▲ 0.055	▲ 0.020	0.000	23,924.92	142.05	109.37-38	109.55-56
T/N							-	▲ 0.058						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.073						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.070						
3W							-	▲ 0.070						
1M							-	▲ 0.076						
3M							▲ 0.110	▲ 0.094						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.166						
									日付	12/19	12/20	12/23	12/24	12/25
									日銀当預残	3,969,000	4,042,700	4,025,200	4,023,500	4,021,800
									準備預金残	3,449,300	3,521,500	3,498,600	3,498,100	3,515,600
									マナタリベース	5,122,300	5,199,200	5,184,700	5,186,600	5,188,500
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.061%	▲0.059%	▲0.058%	▲0.056%
									コール市場残高	108,584	115,031	106,541	103,796	105,442
									うち無担	84,758	87,556	83,620	80,302	81,346
									うちO/N	56,818	58,071	52,365	48,137	49,181
									うち有担	23,826	27,475	22,921	23,494	24,096

●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	オフター額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応募総額(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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2019/12/27	2020/1/14		5,997	5,997				

●2019年12月27日の予定

- *決定会合における主な意見(12月18、19日分)
- *11月の完全失業率(市場予想：2.4%)
- *11月の有効求人倍率(市場予想：1.57倍)
- *11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.4%)
- *11月の商業動態統計速報
- *12月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.6%)

◆本資料は信頼できるとさ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