

Central Daily Market Report

2019年12月27日(金)

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27日		2019年12月30日		2020年1月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 4,200		▲ 1,400		6,000	
財政	▲ 2,500		▲ 5,900		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 6,700		▲ 7,300		▲ 14,000	
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	6,000	▲ 5,800				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 1,300	2,500	▲ 800		
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	▲ 7,800		▲ 5,600		▲ 14,000	
当座預金残高	4,014,400		4,008,800		3,994,800	
準備預金残高	3,501,900					
積み終了先	3,501,000		12月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,501,000		積数		8,600	
非準備預金先	512,500		1日平均		500	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,227,300	
準備預金進捗率	実績	99.73%		日数	45.16%	

●2019年12月27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▲0.080~▲0.035%の出合いが中心となった。一巡後は調整の出合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合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(12/30-1/6)は、▲0.065~▲0.055%程度での出合い。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。アウトライト市場は、年末を控えて動意なく閑散な中、3M物が▲0.1075%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、年初の発行にあたり償還はなかったものの、機械・石油・商社等の幅広い業態がまとまった発行を実施し、発行総額は6,300億円程度に膨らんだ。発行レートは総じてやや上昇傾向であった。

●短期金融市場関連指標

2019/12/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考総値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.056	▲ 0.015	0.005	23,837.72	▲ 87.20	109.52-54	109.50-51
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.062						
2W				▲ 0.035				▲ 0.063						
3W								▲ 0.067						
1M				▲ 0.010				▲ 0.074						
3M							▲ 0.110	▲ 0.093						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.164						

日付	12/20	12/23	12/24	12/25	12/26
日銀当預残	4,042,700	4,025,200	4,023,500	4,021,800	4,022,200
準備預金残	3,521,500	3,498,600	3,498,100	3,515,600	3,510,400
マネタリーベース	5,199,200	5,184,700	5,186,600	5,188,500	5,194,000
無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.059%	▲0.058%	▲0.056%	▲0.055%
コール市場残高	115,031	106,541	103,796	105,442	101,934
うち無担	87,556	83,620	80,302	81,346	81,072
うちO/N	58,071	52,365	48,137	49,181	48,657
うち有担	27,475	22,921	23,494	24,096	20,862

●入札結果

名称	回数	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	募入最高利率	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
本日は日本銀行による金融調節は実施されませんでした。										

●2019年12月30日の予定

*証券取引所大納会	*米国12月のシカゴPM景況感指数
-----------	-------------------

◆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