

# Central Daily Market Report

2019年12月30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30日		2020年1月6日		2020年1月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		6,200		5,000	
財政	▲ 8,800		▲ 23,600		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 9,700		▲ 17,400		4,000	
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	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	▲ 900		900			
当預増減	▲ 8,900		▲ 16,500		4,000	
当座預金残高	4,005,500		3,989,000		3,993,000	
準備預金残高	3,477,600					
積み終了先	3,477,300		1月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,476,700		積数		2,200	
非準備預金先	527,900		1日平均		200	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,226,800	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	67.74%		

## ●2019年12月30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~▲0.05%での調達で始まった。年末越えとなるため調達を控える先も多く、レートは大幅に低下した。午後は出会い少なく、本年最後の取引を終了した。ターム物は年明けスタートのショートターム物で出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(1/6-1/7)は、▲0.110~▲0.065%程度での出会い。売りが薄い局面では▲0.10%近辺での出会いが散見された。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、低下。アウトライ市場は、年内最終営業日となり参加者が少なく、年明けの連続入札を控えて様子見姿勢が強まったためか、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,500億円程度に対して、発行総額は50億円程度と償還超であった。年末につき多くの事業法人が休業中であるため、閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/30	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	▲ 0.068				-	▲ 0.082	▲ 0.025	▲ 0.010	23,656.62	▲ 181.10	109.43-45	109.14-15
T/N							-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.027				-	▲ 0.072						
2W							-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.080						
1M			▲ 0.004				-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.110	▲ 0.100						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.164						
									日付	12/23	12/24	12/25	12/26	12/27
									日銀当預残	4,025,200	4,023,500	4,021,800	4,022,200	4,014,400
									準備預金残	3,498,600	3,498,100	3,515,600	3,510,400	3,502,500
									マネタリーベース	5,184,700	5,186,600	5,188,500	5,194,000	5,190,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.058%	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.051%
									コール市場残高	106,541	103,796	105,442	101,934	100,663
									うち無担	83,620	80,302	81,346	81,072	79,941
									うちO/N	52,365	48,137	49,181	48,657	49,076
									うち有担	22,921	23,494	24,096	20,862	20,722

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/30	2020/1/6	▲ 0.350	892	892		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2020年1月3日の予定

*米国11月の建設支出	*米国12月のISM製造業景況指数
-------------	-------------------

## ●2020年1月6日の予定

*証券取引所大発表
-----------

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願ひ申し上げます。

◆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