# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

#### ●資金需給

単位:億円	●貝並需和								
無給速報 需給予想 当社予想  銀行券 ▲ 2,500 ▲ 3,900 ▲ 5,000  財政 ▲ 13,500 2,600 82,000  資金過不足 ▲ 16,000 ▲ 1,300 77,000  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 は出 全店共通 国債買現 国庫短期証買入 1,000 ■ 11,300 CP等買入 2,500 ▲ 100 資出支援基金(成) 資出支援基金(成) 資出支援基金(成) 資出支援基金(成) 資出支援基金(資)	* /	2019年1	2月18日	2019年1	2月19日	2019年12月20日			
財政 ▲ 13,500 2,600 82,000  資金過不足 ▲ 16,000 ▲ 1,300 77,000  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 スタート エンド 日間	■ 単位:18円 ■	需給	速報	需給	予想	当社予想			
資金過不足 ▲ 16,000 ▲ 1,300 77,000  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 (登出 全店共通 国債買現 国債売現 国庫短期証買入 1,000 国債買入 (CP等買入 2,500 ▲ 100	銀行券	<b>A</b>	2,500	4	3,900	4	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 1,000 111,300 CP等買入 2,500 ▲ 100 食出支援基金(貸) 被災地支援 100 ▲ 100 ▲ 100 ▲ 100 ▲ 100 ▲ 100 ■	財政	<b>A</b>	13, 500		2, 600		82, 000		
貸出 全店共通 国債買現 国債売現 国庫短期証買入 1,000 国債買入 (CP等買入 2,500 ▲ 100 ▲ 200 日 100	資金過不足	<b>A</b>	16,000	4	1,300		77, 000		
全店共通 国債買現 国債売現 国債買入 (CP等買入 2,500 ▲ 100 章 11,300 章 11,3	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		
国債買現 国債売現 国庫短期証買入 1,000 国債買入 CP等買入 2,500 ▲ 100 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(貸) 被災地支援 社債等買入 国債補完供給 ▲ 100 200 100  当座預金残高 3,962,000 3,971,900 4,048,900 事準備預金先 3,387,100 非準備預金先 513,100	貸出								
国債売現 国庫短期証買入 1,000 国債買入 11,300 CP等買入 2,500 ▲ 100 ▲ 200 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(貸) 被災地支援 100 ▲ 100 基1債等買入 100 ▲ 100 基1債等買入 100 ▲ 100 基1債等買入 100 ▼ 100 基1債務 12,500 9,900 77,000 基座預金残高 3,962,000 3,971,900 4,048,900 基準備預金残高 3,448,900 最過準備 3,387,100 非準備預金先 513,100  11,000	全店共通								
国庫短期証買入 1,000 11,300 200 11,300 200 100 200 2	国債買現								
国債買入	国債売現								
CP等買入 2,500 ▲ 100		1, 000							
貸出支援基金(成)   貸出支援基金(貸)   (投)   (投)   (投)   (投)   (投)   (投)   (д)   (				11, 300					
貸出支援基金(貸)	CP等買入	2, 500	▲ 100		▲ 200				
被災地支援 社債等買入 ETF買入 国債補完供給 ▲ 100 200 100 100 100 100 100 100 100 100	貸出支援基金(成)								
社債等買入 ETF買入 国債補完供給     200     100       当預增減     12,500     9,900     77,000       当座預金残高     3,962,000     3,971,900     4,048,900       準備預金残高     3,448,900     12月19日以降の残り所要積立額 積数     12月19日以降の残り所要積立額 積数     44,100       非準備預金先     513,100     1日平均     1,600	貸出支援基金(貸)								
ETF買入 国債補完供給     ▲ 100     200     100       当預増減     ▲ 12,500     9,900     77,000       当座預金残高     3,962,000     3,971,900     4,048,900       準備預金残高     3,448,900     44,100       積み終了先     3,387,100     12月19日以降の残り所要積立額 積数     44,100       非準備預金先     513,100     1日平均     1,600	10.15 1 -5 1101					100	▲ 100		
国債補完供給 ▲ 100 200 100 77,000 3,971,900 77,000 当座預金残高 3,962,000 3,971,900 4,048,900 積み終了先 3,419,900 超過準備 3,387,100 非準備預金先 513,100 100 100 100 100 100 100 100 100 100									
当預増減 ▲ 12,500 9,900 77,000 当座預金残高 3,962,000 3,971,900 4,048,900 準備預金残高 3,448,900 積み終了先 3,419,900 12月19日以降の残り所要積立額 超過準備 3,387,100 非準備預金先 513,100 1日平均 1,600	ETF買入								
当座預金残高 3,962,000 3,971,900 4,048,900 準備預金残高 3,448,900 積み終了先 3,419,900 12月19日以降の残り所要積立額 12別9日以降の残り所要積立額 12別9日以降の残り所要積立額 1日平均 1,600	国債補完供給	▲ 100							
準備預金残高 3,448,900 積み終了先 3,419,900 12月19日以降の残り所要積立額 超過準備 3,387,100 積数 44,100 非準備預金先 513,100 1日平均 1,600	当預増減	•	12, 500		9, 900		77, 000		
積み終了先 3,419,900 12月19日以降の残り所要積立額 23,387,100 積数 44,100 1日平均 1,600	当座預金残高	3, 9	962, 000	3,	971, 900	4,	048, 900		
超過準備 3,387,100 積数 44,100   非準備預金先 513,100 1日平均 1,600	準備預金残高	3,	448, 900						
非準備預金先   513,100   1日平均   1,600	積み終了先				12月19日以	以降の残り	听要積立額		
	超過準備				積数		44, 100		
<b>積み期間 (12/16~1/15) の所亜進備類 3 227 400</b>	非準備預金先		513, 100		1日平均		1,600		
[[[]]] (12/10 1/10/ <b>0</b> 2/1/女牛佣银 0,227,400	積み期間(12/16~	~1/15 <u>)</u> (	の所要準	備額		3,	227, 400		

## ●2019年12月18日の市場動向

#### 〈インターパンク市場〉

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.087~▲0.040%の出合いが中心となった。概ね横ばい圏で推移し、出合い一巡後は調整から▲0.087%の出合いが見られた程度であった。ターム物に関してはショートターム物で出合いが散見された。

#### 〈レポ市場〉

GC T/N(12/19-12/20)は、▲0.100~▲0.090%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。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.125~▲0.115%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1172%、按分落札利回▲0.1053%と、需給環境を反映してか、前回債からレートが上昇する弱めの結果となった。一方、結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.124~▲0.110%出合いと堅調に推移した。この他に6M物が▲0.150%で出合った。

#### 〈CP市場〉

9.68%

現先レートは低位で推移した。発行市場は五・十日発行となり、鉄鋼、石油・石炭製品、機械等複数業態でまとまった額の調達が行われたものの、発行総額は4,000億円程度と償還総額の7,000億円程度を下回った。発行レートについては、発行残高が積み上がっている銘柄や期内物で僅かに上昇したが、全般的には横ばい圏で推移している。

# ●短期金融市場関連指標

準備預金進捗率 実績

2019/12/18		無担(速報)			有担 (速報)	短国	果尿 レポレート	
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計值	平均値
O/N	▲ 0.087	0.003	▲ 0.060				-	▲ 0.092
T/N							-	▲ 0.096
S/N							-	-
1W	▲ 0.035	0.230	▲ 0.020				-	▲ 0.097
2W							-	▲ 0.110
3W							_	▲ 0.110
1M							-	▲ 0.107
3M							▲ 0.165	▲ 0.115
6M							▲ 0.155	▲ 0.159
1Y							▲ 0.123	▲ 0.180

日数

98.63%

7	J	GB新	発10年	債		日経平	均	株価	ドル/円			
	直迫	近値	前日	3比	15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)	
92	<b>A</b> (	0.020	<b>A</b> (	0.005	23	3,934.43		131.69		09.52-53	109.43-45	
96	日付 12		12/	11	11 12/12		12/13		12/16	12/17		
	日銀当預残		3,895	3,895,600		3,896,300		0	3,977,500	3,974,500		
97	準備預金残			3,391,600		3,381,600		3,442,900		3,463,200	3,454,400	
10	マネタリーベース		ース	5,032,300		5,036,300		5,106,000		5,122,100	5,121,300	
10	無担O/N加重平均		重平均	▲0.008%		▲0.009%		▲0.008%		▲0.053%	▲0.057%	
07	コール市場残高		91,551		88,250		79,421		105,082	104,002		
15	うち無担		72,595		69,399		60,202		82,865	82,098		
59		3	50/N	49	,785	46,4	89	39,14	2	57,790	56,073	
80		うち有	担	18	,956	18,8	51	19,21	9	22,217	21,904	

#### ●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 I 非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	877	_	19,000	2019/12/20	2020/12/21	65,783.0	16,178.8	100.1060	▲0.1053%	66.2745%	100.1180	▲0.1172%	2,821.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2019/12/19			6,798	4,206	▲0.003		▲0.001	52.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,400	2019/12/19			8,367	3,407	▲0.003		▲0.003	53.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/12/19			7,801	3,504	▲0.004		▲0.003	97.3
社債等買入	750	2019/12/24			2,852	750	0.050		0.058	83.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/18	2019/12/19	-0.35	119	119		▲0.350	▲0.350	

Ħ	類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ	第104回	2019/12/20	2020/12/18	0	71
被災地金融支援オペ(熊本)	第43回	2019/12/20	2020/12/18	0	0

# ●2019年12月19日の予定

- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)
- \*黒田日銀総裁定例会見

- \*英中銀MPC結果発表
- \*米国11月の米中古住宅販売
- ◆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。
- ◆本資料は何ら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論見書をよくお読みください。

が記し金がらい成びする音画で日端光音であるがかんださい。 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