

# Central Daily Market Report

2019年12月20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20日		2019年12月23日		2019年12月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,100		▲ 2,900		▲ 3,000	
財政	78,000		▲ 13,500		▲ 9,000	
資金過不足	74,900		▲ 16,400		▲ 12,000	
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		▲ 800		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	100	▲ 100				
社債等買入		▲ 600			800	
E T F 買入	900					
国債補完供給	▲ 1,200	500		1,200		
当預増減	73,700		▲ 15,500		▲ 11,200	
当座預金残高	4,042,700		4,027,200		4,016,000	
準備預金残高	3,521,500					
積み終了先	3,520,700		12月23日以降の残り所要積立額		積数 14,800	
超過準備	3,518,000				1日平均 600	
非準備預金先	521,200					
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	99.54%	日数	22.58%		

## ●2019年12月20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。国債の大量償還日にあたったものの、出会い水準に大きな変化は見られず、一巡後は▲0.075~▲0.055%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ショートターム物で出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(12/23-12/24)は、▲0.070~▲0.045%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、レート上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.115~▲0.110%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1061%、按分落札利回▲0.0893%と、テールが流れる弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.110~▲0.105%で推移した。この他に、引け際に1Y物が▲0.120%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場はノンバンクや鉄鋼業態で700億円超のまとまった額の調達が行われ、発行総額は3,500億円程度と償還総額の1,000億円程度を上回った。発行レートについては、期内物で上昇する動きが見られたものの、全般的に横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/20	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.061				-	▲ 0.080	0.005	0.015	23,816.63	▲ 48.22	109.38-39	109.36-38
T/N							-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.074						
2W							-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.110	▲ 0.102						
6M							▲ 0.155	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.176						
									日付	12/13	12/16	12/17	12/18	12/19
									日銀当預残	3,963,200	3,977,500	3,974,500	3,962,000	3,969,000
									準備預金残	3,442,900	3,463,200	3,454,400	3,449,600	3,449,300
									マネタリーベース	5,106,000	5,122,100	5,121,300	5,111,400	5,122,300
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.053%	▲0.057%	▲0.060%	▲0.061%
									コール市場残高	79,421	105,082	104,002	107,129	108,584
									うち無担	60,202	82,865	82,098	85,051	84,758
									うちO/N	39,142	57,790	56,073	58,231	56,818
									うち有担	19,219	22,217	21,904	22,078	23,826

## ●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)
国庫短期証券	878	-	43,400	2019/12/23	2020/3/30	129,292.0	35,573.8	100.0240	▲0.0893%	47.9069%	100.0285	▲0.1061%	7,826.0
流動性供給	300	-	6,000	2019/12/23		15,197.0	5,990.0		0.0180%	74.6905%		0.0130%	

## ●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	入札総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2019/12/20	2019/12/23	▲0.350	1,152	1,152		▲0.350	▲0.350	

## ●2019年12月23日の予定

\*10月の景気動向指数改訂状況

\*米国11月の新築一戸建て販売件数

◆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お客様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