

# Central Daily Market Report

2019年12月25日(水)

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25日		2019年12月26日		2019年12月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,600		▲ 4,900		▲ 3,000	
財政	▲ 2,800		800		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 6,400		▲ 4,100		▲ 6,000	
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						▲ 5,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			5,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F 買入						
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 1,700		1,200		▲ 11,800	
当座預金残高	4,021,800		4,023,000		4,011,200	
準備預金残高	3,515,600					
積み終了先	3,515,000				12月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,514,900				積数 11,800	
非準備預金先	506,200				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	99.63%	日数	32.26%		

## ●2019年12月25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であった。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(12/26-12/27)は、▲0.06～▲0.05%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、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.122～▲0.120%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートは低位横ばい圏で推移した。CP発行市場は、鉄鋼、食品、機械業態などが大型発行を実施したが、7,900億円程の償還に対して、5,900億円程の発行にとどまり、償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。また、CP等買入オベが、事前予定額から500億円減額の2,500億円でおファーされた。今年最後のオベであったが、按分落札レート▲0.001%、平均落札レート0.001%と、按分落札レートは前回比横ばい、平均落札レートでは前回比で上昇する結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2019/12/25	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	▲ 0.056				-	▲ 0.048	▲ 0.020	▲ 0.020	23,782.87	▲ 47.71	109.37-39	109.32-38
T/N							-	▲ 0.057						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.076						
2W							-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.073						
1M							-	▲ 0.080						
3M							▲ 0.110	▲ 0.095						
6M							▲ 0.145	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.170						
									日付	12/18	12/19	12/20	12/23	12/24
									日銀当預残	3,962,000	3,969,000	4,042,700	4,025,200	4,023,500
									準備預金残	3,449,600	3,449,300	3,521,500	3,498,600	3,498,100
									マネタリーベース	5,111,400	5,122,300	5,199,200	5,184,700	5,186,600
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.061%	▲0.061%	▲0.059%	▲0.058%
									コール市場残高	107,129	108,584	115,031	106,541	103,796
									うち無担	85,051	84,758	87,556	83,620	80,302
									うちO/N	58,231	56,818	58,071	52,365	48,137
									うち有担	22,078	23,826	27,475	22,921	23,494

## ●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年以下)	500	2019/12/26			1,188	501	0.006		0.013	91.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2019/12/26			7,672	3,503	▲0.027		▲0.023	96.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2019/12/26			3,174	1,005	▲0.027		▲0.025	54.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2019/12/26			1,192	301	▲0.031		▲0.030	54.7
CP等買入	2,500	2019/12/30			7,470	2,490	▲0.001		0.001	35.7

## ●2019年12月26日の予定

*黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議委員会において講演	*EURO祝日(Christmas Holiday)
*11月の住宅着工統計	*London祝日(Boxing Day)

◆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