

Central Daily Market Report

2017年12月1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	2017年12月1日		2017年12月4日		2017年12月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 600		▲ 1,000	
財政	▲ 10,700		▲ 76,400		5,000	
資金過不足	▲ 12,400		▲ 77,000		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			2,500	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					7,500	
国債買入	7,100				9,900	
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)	6,200	▲ 6,100		▲ 300		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
E T F買入			300			
国債補充供給	▲ 100	500		100		
当預増減	▲ 5,100		▲ 77,000		21,400	
当座預金残高	3,643,100		3,566,100		3,587,500	
準備預金残高	3,230,500					
積み終了先	3,230,000					
超過準備	3,230,000				12月4日以降の残り所要積立額 積数 4,700	
非準備預金先	412,600				1日平均 400	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					2,946,100	
準備預金進捗率	実績	99.84%	日数	60.00%		

●2017年12月1日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比3,000億円減の321兆4,000億円(当座預金残高は364兆3,000億円)。本日の無担O/Nは地銀業態から▲0.070~▲0.045%、都銀・信託業態で▲0.070~▲0.065%の出会いとなった。月末要因が剥落し、週末の取引となったが、特段取り急ぐ動きは見られなかった。一巡後は▲0.075~▲0.055%で調整の出会い。ターム物に関してはショートタームで▲0.035%程度の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/4-12/5)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。S/N(12/5-12/6)は、▲0.090~▲0.085%程度で出会い。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、2Y381・382、5Y130~133、10Y336~348などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は、短国買入オペが業者の在庫が膨らんでいることが考慮されてか、予想上限の7,500億円(前回比+5,000億円)でオファーされた。応札額も25,353億円と多く、平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.006%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.181~▲0.17%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は鉄鋼、卸売業態からまとまった発行が見られたものの、償還総額・発行総額共に、1,600億円程度と横ばいの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

2017/12/1	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.095	0.030	0.000	22,819.03	94.07	112.58-59	112.62-63
T/N			0.000				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.030	▲ 0.028				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.037	▲ 0.035	▲ 0.035				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.146						
3M							▲ 0.178	▲ 0.135						
6M							▲ 0.187	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.182	▲ 0.164						
									日付	11/24	11/27	11/28	11/29	11/30
									日銀当預残	3,629,100	3,637,500	3,645,800	3,646,000	3,648,200
									準備預金残	3,192,800	3,204,800	3,215,000	3,227,600	3,212,300
									マネタリーベース	4,693,300	4,701,700	4,710,900	4,712,100	4,715,600
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.053%	▲0.055%
									コール市場残高	95,403	97,132	100,957	98,321	89,180
									うち無担	73,388	74,621	76,793	74,886	65,651
									うちO/N	42,718	43,191	45,413	44,281	37,776
									うち有担	22,015	22,511	24,164	23,435	23,529

●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)	応募額(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
国庫短期証券買入	7,500	2017/12/5			25,353	7,502	0.006		0.010	37.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/12/5			8,289	2,504	0.003		0.003	80.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/12/5			11,791	3,002	0.002		0.003	5.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/12/5			16,045	4,104	0.005		0.005	77.6
国債買入(物価連動債)	250	2017/12/5			1,085	251	0.100		0.073	30.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	34,489	2017/12/1	2017/12/4		29	29		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,981	2017/12/1	2017/12/4		38	38		▲0.600	▲0.600	

●2017年12月4日の予定

*11月実績/12月見込み財政資金対民間収支	*米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫
*11月のマネタリーベース	
*11月の消費動向調査	

◆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