

Central Daily Market Report

2017年12月4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	2017年12月4日		2017年12月5日		2017年12月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,300		▲ 1,000	
財政	▲ 77,300		7,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 77,900		6,300		▲ 3,000	
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						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入			10,000			
CP等買入		▲ 100		▲ 1,000		
貸出支援基金(成)		▲ 300				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入		▲ 100				
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 78,000		22,900		▲ 3,000	
当座預金残高	3,565,100		3,588,000		3,585,000	
準備預金残高	3,170,700					
積み終了先	3,170,200		12月5日以降の残り所要積立額		積数 4,200	
超過準備	3,170,200		1日平均		400	
非準備預金先	394,400					
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		99.86%		日数 63.33%	

●2017年12月4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4兆9,000億円減の316兆5,000億円(当座預金残高見込みは356兆6,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、外銀から▲0.065~▲0.045%の調達で出合いが見られた。税揚げによる不足日で資金調達サイドは比較的しっかりしており、一巡後も▲0.070~▲0.040%のレンジで推移した。ターム物に関してはショートタームで▲0.040%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/5-12/6)は、▲0.095~▲0.080%程度での出合い。S/N(12/6-12/7)は、▲0.090~▲0.080%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、2Y381・382、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~56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、動意なく閑散で、特段の出合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。CP発行市場は償還総額500億円強に対して、発行総額は1,500億円強と発行超。一部の石油・卸売・機械業態において大型案件が見られ、月の初旬としては比較的多めの発行量であった。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

2017/12/4	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	0.035	0.005	22,707.16	▲ 111.87	112.88-90	112.99-00
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.094						
T/N			0.000				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.039				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.172	▲ 0.133						
6M							▲ 0.180	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.163						
日付		11/27	11/28	11/29	11/30	12/1								
日銀当預残	3,637,500	3,645,800	3,646,000	3,648,200	3,643,100									
準備預金残	3,204,800	3,215,000	3,227,600	3,212,300	3,230,500									
マネタリーベース	4,701,700	4,710,900	4,712,100	4,715,600	4,712,200									
無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.053%	▲ 0.053%	▲ 0.055%	▲ 0.056%									
コール市場残高	97,132	100,957	98,321	89,180	100,770									
うち無担	74,621	76,793	74,886	65,651	76,312									
うちO/N	43,191	45,413	44,281	37,776	47,767									
うち有担	22,511	24,164	23,435	23,529	24,458									

●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	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)	20,000	2017/12/4	2017/12/5		101	101		▲ 0.600	▲ 0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	2,467	2017/12/4	2017/12/5		3	3		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年12月5日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国10月の貿易収支 *米国11月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札 (23,000億円、12/20発行)
--------------------	-----------------------------------	----------------------------------

◆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