

# Central Daily Market Report

2017年12月5日(火)

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5日		2017年12月6日		2017年12月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	7,100		▲ 1,500		3,000	
資金過不足	5,700		▲ 2,900		1,000	
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	7,500					
国債買入	10,000					
CP等買入		▲ 1,000		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当増減	22,200		▲ 3,400		1,000	
当座預金残高	3,587,300		3,583,900		3,584,900	
準備預金残高	3,185,400					
積み終了先	3,185,000				12月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,185,000				積数 3,800	
非準備預金先	401,900				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	99.87%	日数	66.67%		

## ●2017年12月5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3兆円増加の319兆5,000億円(当座預金残高見込みは358兆8,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、外銀から▲0.065~▲0.040%の調達で出会いが見られた。一巡後も▲0.060~▲0.045%でビッドが残るなどしっかりと地合いであった。ターム物に関してはショートタームで▲0.035%の出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(12/6-12/7)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。S/N(12/7-12/8)は、▲0.085~▲0.075%程度で出会い。オフアース資金調達ニーズが堅調になっておりレート目線をやや切り上げながらの推移となった。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.14~▲0.13%で出合った。WI取引では6日入札の6M物が▲0.15~▲0.14%で出合った。

### <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200億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超。一部の卸売・その他金融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

2017/12/5	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.089	0.055	0.020	22,622.38	▲ 84.78	112.49-51	112.62-64
T/N			0.000				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.040				-	▲ 0.091						
2W							-	▲ 0.094						
3W			0.000				-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.147	▲ 0.129						
6M							▲ 0.158	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.161						
									日付	11/28	11/29	11/30	12/1	12/4
									日銀当預残	3,645,800	3,646,000	3,648,200	3,643,100	3,565,100
									準備預金残	3,215,000	3,227,600	3,212,300	3,230,500	3,170,800
									マネタリーベース	4,710,900	4,712,100	4,715,600	4,712,200	4,634,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.053%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.052%
									コール市場残高	100,957	98,321	89,180	100,770	94,087
									うち無担	76,793	74,886	65,651	76,312	71,027
									うちO/N	45,413	44,281	37,776	47,767	43,242
									うち有担	24,164	23,435	23,529	24,458	23,060

## ●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)
10年利付国債	349	0.10%	23,000	2017/12/20	2037/12/20	70,327.0	18,985.00	100.3500	0.0640%	88.8083%	100.4000	0.0590%	4,001.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,065	2017/12/5	2017/12/6		20	20		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,464	2017/12/5	2017/12/6		54	54		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2017/12/7	2017/12/14	1.66	2	2				

## ●2017年12月6日の予定

*政井日銀審議委員、 兵庫県金融経済懇談会にて講演	*国庫短期証券(725回)入札 (6ヶ月、23,000億円、12/11発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、12/14借入)
------------------------------	---	----------------------------------

◆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