

# Central Daily Market Report

2017年12月8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8日		2017年12月11日		2017年12月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 1,200		▲ 3,000	
財政	5,500		▲ 12,100		▲ 1,000	
資金過不足	3,400		▲ 13,300		▲ 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			3,000	▲ 2,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入					12,500	
国債買入	4,700				8,400	
CP等買入		▲ 200	4,000	▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	200		400			
国債補完供給	▲ 400	500		400		
当預増減	8,100		▲ 8,000		16,900	
当座預金残高	3,595,600		3,587,600		3,604,500	
準備預金残高	3,195,100					
積み終了先	3,194,500				12月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,194,500				積数	
非準備預金先	400,500				1日平均	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					2,950,300	
準備預金進捗率	実績		99.97%		日数	
					83.33%	

## ●2017年12月8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2兆円増の320兆7,000億円(当座預金残高は359兆7,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・外銀・証券業態より▲0.055~▲0.040%の調達希望で始まった。▲0.040%で寄り付き後は▲0.055~▲0.030%のレンジで出合い。週末要因で一巡後もビッドが残る展開となり、午後▲0.030%が出合うなど堅調に推移した。ターム物に関しては、ショートタームで▲0.030%の出合い。

### <レポ市場>

GC T/N(12/11-12/12)は、▲0.060~▲0.045%程度での出合い。S/N(12/12-12/13)は、▲0.065~▲0.055%程度で出合い。S/Nは短国・国債買入オペがオファーされたもののレートはほぼ横ばいでの推移となった。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、短国買入オペが事前予想通りの12,500億円(前回比+5,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差▲0.001%、按分落札利回較差▲0.004%と小じっかりした結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.17~▲0.15%、6M物が▲0.174~▲0.165%での出合いが見られた。

### <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600億円程度に対して、発行総額は800億円程度と若干の発行超であった。一部の卸売業態において大型案件が見られたものの、案件数は少なく盛り上がり欠ける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

2017/12/8	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.072	0.045	▲ 0.005	22,811.08	313.05	113.20-22	113.46-48
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.052						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.077						
2W							-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.120						
1M							-	▲ 0.117						
3M							▲ 0.166	▲ 0.121						
6M							▲ 0.171	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.163						
									日付	12/1	12/4	12/5	12/6	12/7
									日銀当預残	3,643,100	3,565,100	3,587,300	3,583,100	3,587,500
									準備預金残	3,230,500	3,170,800	3,185,400	3,162,500	3,183,400
									マネタリーベース	4,712,200	4,634,800	4,658,300	4,655,700	4,662,800
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.034%	▲0.043%
									コール市場残高	100,770	94,087	101,101	102,615	94,260
									うち無担	76,312	71,027	77,835	80,187	70,754
									うちO/N	47,767	43,242	49,650	52,412	42,709
									うち有担	24,458	23,060	23,266	22,428	23,506

## ●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)	募入最低値	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)
エネルギー対策	-	-	5,500	2017/12/20	2018/12/20	83,798.0	5,499.99		0.0000%	6.6585%		0.0000%	

## ●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	12,500	2017/12/12			24,062	12,502	▲0.004		▲0.001	53.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/12/12			7,636	2,507	▲0.009		▲0.008	65.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/12/12			7,643	3,003	▲0.010		▲0.008	1.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/12/12			5,143	2,004	▲0.010		▲0.008	27.0
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/12/12			2,928	903	▲0.015		▲0.012	98.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,785	2017/12/8	2017/12/11		339	339		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,585	2017/12/8	2017/12/11		54	54		▲0.500	▲0.500	

## ●2017年12月11日の予定

- \*10-12月期の法人企業景気予測調査季報
- \*11月のマネーストック
- \*10月の特定サービス産業動態統計速報

◆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