

Central Daily Market Report

2017年12月11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11日		2017年12月12日		2017年12月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 1,800		▲ 2,000	
財政	▲ 13,500		2,400		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 14,700		600		▲ 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						
国庫短期証買入			12,500			
国債買入			8,700			
CP等買入	4,000	▲ 300		▲ 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	400		500			
国債補完供給	▲ 300	400		300		
当預増減	▲ 9,700		22,200		▲ 4,000	
当座預金残高	3,585,900		3,608,100		3,604,100	
準備預金残高	3,202,100					
積み終了先	3,201,900		12月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,201,800		積数		500	
非準備預金先	383,800		1日平均		100	
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	99.98%	日数	86.67%		

●2017年12月11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320兆4,000億円(当座預金残高は358兆8,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・外銀・証券業態より▲0.050~▲0.035%の調達希望から始まった。積み期間最終週に入ったこともあり資金調達ニーズは引き続き堅調で、▲0.045~▲0.030%でまとまった出会いとなった。一巡後は▲0.050~▲0.030%で調整の出会いが見られた。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.035~▲0.025%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/12-12/13)は、▲0.065~▲0.055%程度での出会い。S/N(12/13-12/14)は、▲0.05~▲0.045%程度で出会い。投資家の旺盛な資金調達需要からか、レートは上昇基調となっている。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▲0.175~▲0.168%、6M物が少額のみ▲0.175%、1Y物が▲0.165%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。発行市場は、件数は少ないながらも、電気機器や機械業態で大ロットの調達が見られ、償還総額800億円弱に対し、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、大ロットの物も安定的に消化されており、引き続き0%近辺の低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/12/11	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.066	0.045	0.000	22,938.73	127.65	113.56-57	113.43-45
T/N			0.000				-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.118						
1M			0.050				-	▲ 0.113						
3M			0.050				▲ 0.167	▲ 0.118						
6M							▲ 0.171	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.163						
									日付	12/4	12/5	12/6	12/7	12/8
									日銀当預残	3,565,100	3,587,300	3,583,100	3,587,500	3,595,600
									準備預金残	3,170,800	3,185,400	3,162,500	3,183,400	3,195,200
									マナリーベース	4,634,800	4,658,300	4,655,700	4,662,800	4,673,000
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.050%	▲0.034%	▲0.043%	▲0.038%
									コール市場残高	94,087	101,101	102,615	94,260	93,943
									うち無担	71,027	77,835	80,187	70,754	71,334
									うちO/N	43,242	49,650	52,412	42,709	43,724
									うち有担	23,060	23,266	22,428	23,506	22,609

●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	応募総額(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)	67,543	2017/12/11	2017/12/12		242	242		▲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	2017/12/11	2017/12/12		52	52		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月12日の予定

*10月の第3次産業活動指数	*米国FOMC(1日目)	*5年利付国債入札(22,000億円、12/20発行)
*11月の企業物価指数	*米国11月の財政収支	
	*米国11月の生産者物価指数	
	*英国11月の英消費者物価指数	

◆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