

Central Daily Market Report

2017年12月12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12日		2017年12月13日		2017年12月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 1,700		▲ 3,000	
財政	2,000		2,500		2,000	
資金過不足	200		800		▲ 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	12,500					
国債買入	8,700					
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
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		▲ 100		
E T F買入	500		700			
国債補完供給	▲ 600	300		600		
当預増減	21,200		1,800		▲ 1,000	
当座預金残高	3,607,100		3,608,900		3,607,900	
準備預金残高	3,220,100					
積み終了先	3,219,900				12月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,219,900				積数	
非準備預金先	387,000				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		99.99%		日数	
					90.00%	

●2017年12月12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1兆6,000億円増の322兆円(当座預金残高は360兆8,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き堅調な展開となった。▲0.035%で寄り付いた後は、邦銀・外銀・証券業態より▲0.040~▲0.030%の調達が見られた。調達一巡後も、同水準での出合いに終始した。ターム物に関しては、月内のショートタームで▲0.030~▲0.020%の出合い。

<レポ市場>

GC T/N(12/13-12/14)は、▲0.05~▲0.045%程度での出合い。S/N(12/14-12/15)は、▲0.045~▲0.04%程度での出合い。投資家の旺盛な資金調達需要が継続しており、レートは上昇した。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、動意薄の中、3M物が▲0.182~▲0.175%、6M物が▲0.175%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、電気機器、石油等の業態でまとまった額の調達が見られ、償還総額1,400億円強に対し、発行総額は1,600億円程度と発行超となった。発行レートは一部の銘柄を除き、引続き0%近辺で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/12/12	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.053	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.061	0.040	▲ 0.005	22,866.17	▲ 72.56	113.54-56	113.46-47
T/N			0.000				-	▲ 0.050						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.073						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.120						
1M	0.055	0.059	0.057				-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.170	▲ 0.118						
6M							▲ 0.173	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.163						
									日付	12/5	12/6	12/7	12/8	12/11
									日銀当預残	3,587,300	3,583,100	3,587,500	3,595,600	3,585,900
									準備預金残	3,185,400	3,162,500	3,183,400	3,195,200	3,203,000
									マナタリーベース	4,658,300	4,655,700	4,662,800	4,673,000	4,664,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.050%	▲ 0.034%	▲ 0.043%	▲ 0.038%	▲ 0.036%
									コール市場残高	101,101	102,615	94,260	93,943	90,366
									うち無担	77,835	80,187	70,754	71,334	69,218
									うちO/N	49,650	52,412	42,709	43,724	41,528
									うち有担	23,266	22,428	23,506	22,609	21,148

●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)
5年利付国債	134	0.10%	22,000	2017/12/20	2022/12/20	78,293.0	17,870.00	101.0200	▲0.1020%	83.4736%	101.0300	▲0.1040%	4,122.0

●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)	96,617	2017/12/12	2017/12/13		564	564		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/12/14	2017/12/21	1.86	3	3				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2017/12/13	2017/12/22		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2017年12月13日の予定

*10月の機械受注統計 (市場予想・船舶・電力除く民需、前月比+3.0%)	*米国FOMC(2日目) *米国FRB経済見通し発表 *米国11月の消費者物価指数	*交付税特別会計 (10,500億円、12/21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