

Central Daily Market Report

2017年12月15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15日		2017年12月18日		2017年12月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,500		▲ 1,400		▲ 5,000	
財政	52,600		▲ 7,300		▲ 1,000	
資金過不足	50,100		▲ 8,700		▲ 6,000	
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			4,100	▲ 2,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					2,500	
国債買入	9,700				3,900	
CP等買入		▲ 500		▲ 500	4,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	28,900	▲ 14,500				
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
E T F買入	200		400			
国債補完供給	▲ 900	300		900		
当預増減	73,100		▲ 6,300		4,900	
当座預金残高	3,681,500		3,675,200		3,680,100	
準備預金残高	3,249,300					
積み終了先	3,249,300					
超過準備	3,249,200					
非準備預金先	432,200					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,048,200	
準備預金進捗率	実績	95.26%	日数	6.45%		

●2017年12月15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6兆9,000億増の326兆4,000億円(当座預金残高見込みは368兆4,000億円)。本日の無担O/Nは積み最終日の取引となり、昨日対比で弱含みの動きとなった。▲0.035%で寄り付き後は▲0.040~▲0.030%で邦銀・外銀・証券業態の調達が見られた。調達一巡後はビッドサイドが薄くなり、▲0.060~▲0.040%と水準を切下げたの出会いが散見された。午後は特段の出会いが見られなかった。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.040%程度のお合い。

<レポ市場>

GC T/N(12/18-12/19)は、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。S/N(12/19-12/20)は、▲0.12~▲0.10%程度で出会い。S/Nは、買入オペを受けた業者勢の玉確保姿勢の強まりから、レートが低下した。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、短国買入オペが事前予想通りの2,500億円(前回比▲10,000億円)でオフアされた。買入額が少ないことによる在庫処分からか、平均落札利回較差+0.012%、全取落札利回較差+0.011%と小甘い結果となった。マーケットでは、カレント銘柄は特段の出会いは見られなかった。WI取引で、18日入札の1Y物が▲0.16%で出会った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場はノンバンク、鉄鋼業態でまとまったロットの発行が見られ、発行総額、償還総額ともに1,300億円程度となった。発行レートは引続き0%近辺の狭いレンジで推移している。年末越え案件が少なかったこともあり、昨日のオペレート低下の影響は特段見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2017/12/15	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.080	0.040	▲ 0.005	22,553.22	▲ 141.23	112.39-40	112.15-16
T/N			0.000				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.106						
2W							-	▲ 0.179						
3W							-	▲ 0.156						
1M							-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.174	▲ 0.130						
6M							▲ 0.169	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.163						
									日付	12/8	12/11	12/12	12/13	12/14
									日銀当預残	3,595,600	3,585,900	3,607,100	3,608,800	3,608,400
									準備預金残	3,195,200	3,203,000	3,220,900	3,212,200	3,196,100
									マネタリーベース	4,673,000	4,664,600	4,687,600	4,690,900	4,693,300
									無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.036%	▲0.034%	▲0.032%	▲0.026%
									コール市場残高	93,943	90,366	89,538	92,251	93,160
									うち無担	71,334	69,218	68,072	71,179	72,240
									うちO/N	43,724	41,528	40,762	43,109	43,690
									うち有担	22,609	21,148	21,466	21,072	20,920

●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	2,500	2017/12/19			12,924	2,500		0.011	0.012	
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/12/19			6,010	2,006	▲0.006		▲0.004	30.5
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/12/19			3,089	904	▲0.005		▲0.004	37.2
国債買入(変動利付債)	1,000	2017/12/19			1,986	1,001	▲0.030		▲0.145	52.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	135,758	2017/12/15	2017/12/18		817	817		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	49,888	2017/12/15	2017/12/18		54	54		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月18日の予定

*11月の貿易統計	*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(728回)入札(1年、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