

Central Daily Market Report

2017年12月25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25日		2017年12月26日		2017年12月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,400		▲ 2,700		▲ 3,000	
財政	▲ 9,000		▲ 6,500		3,000	
資金過不足	▲ 11,400		▲ 9,200		0	
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	5,200	▲ 3,100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入					7,000	
CP等買入		▲ 1,100		▲ 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	1,500	▲ 100				
E T F買入	300		300			
国債補完供給	▲ 400	400		400		
当預増減	▲ 8,700		1,200		7,000	
当座預金残高	3,695,400		3,696,600		3,703,600	
準備預金残高	3,265,600					
積み終了先	3,264,400					
超過準備	3,264,400					
非準備預金先	429,800					
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	99.84%	日数	32.26%		

●2017年12月25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15,000億円減少の327兆円(当座預金残高見込みは369兆6,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き地銀・証券業態を中心に調達姿勢が若干強く、レートもやや強含みで推移した。朝方は地銀・証券業態で▲0.045~▲0.04%、信託・外銀業態で▲0.055~▲0.04%の調達が見られた。一巡後は▲0.055~▲0.04%の出合いが散見された。ターム物は特段目立った動きはなく閑散だった。

<レポ市場>

GC T/N(12/26-12/27)は、▲0.09~▲0.085%程度での出合い。S/N(12/27-12/28)は、▲0.095~▲0.085%程度で出合い。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、2Y381~383、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、1Y物が▲0.155~▲0.15%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、2,400億円弱の償還に対して、2,300億円弱の発行とほぼ同水準。ノンバンク、石油業態から大型発行が見られた。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2017/12/25	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.092	0.035	▲ 0.010	22,939.18	36.42	113.30-33	113.24-26
T/N			0.000				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.171						
2W							-	▲ 0.144						
3W							-	▲ 0.133						
1M							-	▲ 0.124						
3M			0.050				▲ 0.196	▲ 0.128						
6M							▲ 0.160	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.161						
									日付	12/18	12/19	12/20	12/21	12/22
									日銀当預残	3,673,100	3,686,800	3,711,200	3,697,500	3,704,100
									準備預金残	3,239,200	3,251,800	3,278,900	3,271,900	3,281,000
									マネタリーベース	4,761,900	4,778,900	4,806,500	4,796,800	4,807,100
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.045%
									コール市場残高	105,349	107,413	109,844	110,359	113,008
									うち無担	84,156	85,305	87,127	86,004	89,874
									うちO/N	51,416	50,625	52,097	50,699	52,939
									うち有担	21,193	22,108	22,717	24,355	23,134

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/12/27			14,264	4,104	▲0.011		▲0.009	26.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/12/27			6,722	2,005	▲0.008		▲0.006	44.4
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/12/27			3,616	907	▲0.007		▲0.006	22.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,468	2017/12/25	2017/12/26		310	310		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	1,000	2017/12/25	2017/12/26		29	29		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月26日の予定

- *黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議員会にて講演
- *金融政策決定会合議事要旨(10月30、31日分)
- *11月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+0.5%)
- *11月の完全失業率(市場予想：2.8%) *11月の有効求人倍率(市場予想：1.56倍)
- *11月全国・12月都都区部消費者物価指数(GPI)
市場予想：全 国(11月)前年同月比(除く生鮮)+0.8%
市場予想：東京都都区部(12月)前年同月比(除く生鮮)+0.7%
- *11月の企業向けサービス価格指数
- *EURO祝日(Christmas Holiday)
- *London祝日(Boxing Day)
- *米国10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *2年利付国債入札(22,000億円、1/15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