

Central Daily Market Report

2017年12月26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26日		2017年12月27日		2017年12月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 3,000		▲ 2,000	
財政	▲ 5,800		▲ 1,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 8,500		▲ 4,600		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入			7,200			
CP等買入		▲ 300	▲ 1,200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	300		200			
国債補完供給	▲ 500	400		500		
当預増減	1,400		2,100		▲ 4,000	
当座預金残高	3,696,800		3,698,900		3,694,900	
準備預金残高	3,270,100					
積み終了先	3,269,400				12月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,269,400				積数 4,400	
非準備預金先	426,700				1日平均 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	99.86%	日数	35.48%		

●2017年12月26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6,000億円増加の327兆6,000億円(当座預金残高見込みは369兆7,000億円)。本日の無担O/Nは年内の積みの調整が本格化し、全般的に強含みで推移した。朝方は地銀・証券業態で▲0.04~▲0.035%、信託・外銀業態で▲0.055~▲0.04%の調達が見られた。一巡後は▲0.04%近辺で散発的な出会いが見られた。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(12/27-12/28)は、▲0.090~▲0.085%程度での出会い。S/N(12/28-12/29)は、▲0.090~▲0.085%程度で出会い。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、動意に乏しく、3M物が▲0.195~▲0.19%、1Y物が▲0.153%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、4,700億円強の償還に対して、4,000億円程度の発行にとどまった。商社・石油業態からはまとまったロットの発行が実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。また、CP等買入オペアが、事前予定よりも500億円増額され、前回比1,000億円増の5,500億円でおファーされたものの、平均落札レートは前回比横ばいの▲0.002%、按分落札レートは前回(▲0.006%)から上昇して▲0.005%の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2017/12/26	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.091	0.040	0.005	22,892.69	▲ 46.49	113.30-32	113.28-30
T/N			0.000				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.171						
2W			0.070				-	▲ 0.141						
3W							-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.194	▲ 0.127						
6M							▲ 0.160	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.153	▲ 0.161						
									日付	12/19	12/20	12/21	12/22	12/25
									日銀当預残	3,686,800	3,711,200	3,697,500	3,704,100	3,695,400
									準備預金残	3,251,800	3,278,900	3,271,900	3,281,000	3,265,600
									マネタリーベース	4,778,900	4,806,500	4,796,800	4,807,100	4,800,800
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.047%	▲0.046%	▲0.045%	▲0.043%
									コール市場残高	107,413	109,844	110,359	113,008	106,875
									うち無担	85,305	87,127	86,004	89,874	83,941
									うちO/N	50,625	52,097	50,699	52,939	47,586
									うち有担	22,108	22,717	24,355	23,134	22,934

●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)
2年利付国債	384	0.10%	22,000	2018/1/15	2020/1/15	78,542.0	18,184.00	100.4650	▲0.1310%	20.5636%	100.4740	▲0.1360%	3,809.0

●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
CP等買入	5,500	2017/12/29			12,180	5,485	▲0.005		▲0.002	52.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,000	2017/12/26	2017/12/27		465	465		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月27日の予定

*11月の住宅着工統計

*米国12月のCB消費者信頼感指数

◆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