

# Central Daily Market Report

2017年12月27日(水)

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27日		2017年12月28日		2017年12月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,100		▲ 3,200		100	
財政	▲ 3,500		▲ 4,500		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 6,600		▲ 7,700		▲ 900	
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						
国債買入	7,200				6,300	
CP等買入		▲ 1,200		▲ 1,000	5,500	
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	200		800			
国債補完供給	▲ 900	500		900		
当預増減	▲ 800		▲ 7,000		10,900	
当座預金残高	3,696,000		3,689,000		3,699,900	
準備預金残高	3,271,000					
積み終了先	3,270,500				12月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,270,500				積数	
非準備預金先	425,000				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	99.87%	日数	38.71%		

## ●2017年12月27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2,000億円増加の327兆8,000億円(当座預金残高見込みは369兆9,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き調達サイドの調整から強含みで推移した。朝方は地銀・証券業態で▲0.04~▲0.03%、信託・外銀業態で▲0.045~▲0.035%の調達が見られた。一巡後は▲0.04%近辺で散發的な出合いが見られた。ターム物は1月スタートのショートタームで▲0.04%近辺の引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(12/28-12/29)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。S/N(12/29-1/4)は、▲0.105~▲0.095%程度での出合い。S/Nは年末初物の取引であったが、波乱の無い展開となった。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、2Y381~383、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、動意なく閑散で、3M物が▲0.195%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、期末スタートの発行となったため、幅広い業態から入札が実施され、鉄鋼・ノンバンク・機械・商社等の業態からは大口の発行が実施された。しかし、年末発行にあたることから、2兆7,300億円程度の償還に対して、発行は8,200億円程度にとどまり、例年通り大幅な償還超となった。発行レートについては、前日までの地合いと大きな変化は無く、0%付近での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2017/12/27	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	▲ 0.037				-	▲ 0.091	0.050	0.010	22,911.21	18.52	113.20-22	113.18-19
T/N			0.000				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	0.003	0.010	0.008				-	▲ 0.166						
2W							-	▲ 0.137						
3W							-	▲ 0.128						
1M							-	▲ 0.120						
3M			0.050				▲ 0.191	▲ 0.126						
6M							▲ 0.159	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.151	▲ 0.161						
									日付	12/20	12/21	12/22	12/25	12/26
									日銀当預残	3,711,200	3,697,500	3,704,100	3,695,400	3,696,800
									準備預金残	3,278,900	3,271,900	3,281,000	3,265,600	3,270,100
									マネタリーベース	4,806,500	4,796,800	4,807,100	4,800,800	4,805,000
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.046%	▲0.045%	▲0.043%	▲0.039%
									コール市場残高	109,844	110,359	113,008	106,875	108,207
									うち無担	87,127	86,004	89,874	83,941	85,337
									うちO/N	52,097	50,699	52,939	47,586	49,252
									うち有担	22,717	24,355	23,134	22,934	22,870

## ●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1年以下)	500	2017/12/29			2,608	506	0.006		0.007	43.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/12/29			7,538	2,503	0.003		0.004	87.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/12/29			10,734	3,005	0.003		0.004	62.1
国債買入(物価連動債)	250	2017/12/29			1,094	250	0.300		0.200	70.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	44,349	2017/12/27	2017/12/28		915	915		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/12/29	2018/1/11	1.88	160	160				

## ●2017年12月28日の予定

*決定会合における主な意見(12月20,21日分 8:50)
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(経済産業省 8:50)
*11月の商業動態統計速報(経済産業省 8:50)

◆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