

Central Daily Market Report

2017年12月28日(木)

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28日		2017年12月29日		2018年1月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,200		▲ 900			6,000
財政	▲ 3,500		▲ 4,300			2,000
資金過不足	▲ 6,700		▲ 5,200			8,000
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					3,000	▲ 4,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,300		7,000	
CP等買入		▲ 1,000	5,500	▲ 4,100		
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	800					
国債補充供給	▲ 700	900		700		
当預増減	▲ 6,700		3,200			13,900
当座預金残高	3,689,300		3,692,500			3,706,400
準備預金残高	3,260,300					
積み終了先	3,259,700				12月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,259,700				積数	3,300
非準備預金先	429,000				1日平均	200
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						3,048,000
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	41.94%		

●2017年12月28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17,000億円減少の326兆1,000億円(当座預金残高見込みは368兆9,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き調達サイドの調整的な動き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▲0.05~▲0.04%の調達が見られた。一巡後は調達サイドがやや引き気味となるも▲0.04%台で散発的な出会いが見られた。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。共通担保資金供給オペは、8,000億円(1/4~1/15)でオファーされ、応札額2,962億円(期落ち分4,112億円)の札割れとなった。

＜レポ市場＞

GC T/N(12/29-1/4)は、▲0.105~▲0.090%程度での出会い。S/N(1/4-1/5)は、▲0.075~▲0.070%程度で出会い。年初の取引となるS/Nは、投資家の資金調達ニーズが強く、前日比でレート上昇となった。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、年末のポジション調整からか、売り物が散見され、3M物は▲0.18~▲0.15%、1Y物は▲0.14%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、期初の発行にあたるため、償還総額は少額だったものの、発行総額は6,300億円程度まで膨らんだ。鉄鋼・機械・石油業態などからは大型発行案件も実施された。発行レートに目立った変動は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2017/12/28	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.091	0.050	0.000	22,783.98	▲ 127.23	113.22-23	112.72-73
T/N			▲ 0.075				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.040				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.038				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.097						
1M			0.000				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.178	▲ 0.124						
6M							▲ 0.156	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.161						
									日付	12/21	12/22	12/25	12/26	12/27
									日銀当預残	3,697,500	3,704,100	3,695,400	3,696,800	3,696,000
									準備預金残	3,271,900	3,281,000	3,265,600	3,270,100	3,271,000
									マネタリーベース	4,796,800	4,807,100	4,800,800	4,805,000	4,807,200
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.045%	▲0.043%	▲0.039%	▲0.037%
									コール市場残高	110,359	113,008	106,875	108,207	112,455
									うち無担	86,004	89,874	83,941	85,337	89,702
									うちO/N	50,699	52,939	47,586	49,252	54,057
									うち有担	24,355	23,134	22,934	22,870	22,753

●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)	応募率(%)	落札最低額	落札最高利回り	案分率	落札平均価格	落札平均利回り	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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/1/4	2018/1/15		2,962	2,962				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2018/1/4			15,252	4,111	▲0.003		▲0.002	75.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2018/1/4			6,261	2,001	0.000		0.000	92.9
国債買入(残存期間25年超)	900	2018/1/4			3,303	905	▲0.006		▲0.006	77.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,008	2017/12/28	2017/12/29		641	641		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月29日の予定

*証券取引所大納会	*12月のシカゴPM景況感指数
-----------	-----------------

◆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