

Central Daily Market Report

2018年12月3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	2018年12月3日		2018年12月4日		2018年12月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 41,500		▲ 78,400		▲ 18,000	
資金過不足	▲ 42,100		▲ 79,400		▲ 19,000	
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	1,900	▲ 1,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,200		8,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)	4,100	▲ 6,900				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 700	2,600		700		
当預増減	▲ 35,500		▲ 70,800		▲ 19,000	
当座預金残高	3,877,400		3,806,600		3,787,600	
準備預金残高	3,412,600					
積み終了先	3,412,300		12月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,412,300		積数		2,000	
非準備預金先	464,800		1日平均		200	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,008,500	
準備預金進捗率	実績		99.93%		日数	
					60.00%	

●2018年12月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週に引き続き各業態ともに調達需要は低く、邦銀を中心に▲0.086~▲0.04%の調達で始まった。ビッドサイドの参加者が限られていたことから、オファーサイドは出し残る先が複数見られた。ターム物は、1~2W物のショートタームで▲0.04~▲0.03%近辺の引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(12/3-12/4)は▲0.09~▲0.08%程度、T/N(12/4-12/5)は▲0.10~▲0.085%程度で出合いが見られた。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10Y341~352や、5Y133などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.175%、引け際に6M物が▲0.215%、1Y物が▲0.15%で出合った。

<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1社で700億円程度の大規模案件が実施された他、建設業等でまとまった額の調達が散見され、発行総額は2,000億円程度と償還総額の100億円程度を上回った。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/12/3	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.069				-	▲ 0.091	0.080	▲ 0.005	22,574.76	223.70	113.76-78	113.46-47
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.038	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.126						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.162						
3M							▲ 0.170	▲ 0.156						
6M							▲ 0.215	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.159						
									日付	11/26	11/27	11/28	11/29	11/30
									日銀当預残	3,902,000	3,911,400	3,907,000	3,909,700	3,912,900
									準備預金残	3,406,600	3,418,700	3,414,800	3,418,300	3,424,400
									マネタリーベース	5,003,100	5,012,800	5,008,700	5,013,000	5,016,700
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.073%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.062%
									コール市場残高	101,525	99,816	96,884	101,360	88,984
									うち無担	80,786	84,394	78,868	81,763	69,361
									うちO/N	47,796	52,404	47,078	49,033	38,691
									うち有担	20,739	15,422	18,016	19,597	19,623

●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	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	2018/12/4			1,857	501	0.013		0.019	59.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/12/4			8,517	3,509	0.001		0.002	27.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/12/4			6,529	4,008	▲0.003		▲0.002	99.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	198,360	2018/12/3	2018/12/4		697	697		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	12,536	2018/12/3	2018/12/4		0	0				

●2018年12月4日の予定

*11月のマネタリーベース	*10年利付国債入札
*11月実績/12月見込み財政資金対民間収支	(22,000億円、12/5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