Central Daily Market Report

2018年12月5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	2018年12月5日 需給速報		2018年12月6日 需給予想		2018年12月7日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 2,200		▲ 3,000	
財政	▲ 27,300		2,700		2,000	
資金過不足	▲ 28,700		500		▲ 1,000	
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	1,000					
国債買入			7,600			
CP等買入		▲ 100		▲ 100	2,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 900	800		900		
当預増減	▲ 27,900		8,900		1,000	

当座預金残高	3,776,700	3,785,600	3,786,600
準備預金残高	3,309,800		
積み終了先	3,309,600		
超過準備	3,309,600		
非準備預金先	466,900		

12月6日以降の残り所要積立額	
積数	1,700
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	99.94%	日数 66.67%

●2018年12月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.086～▲0.04%の調達で始まった。出合い水準に大きな変化は無かったものの、いくつかの業態から調達需要の増加が見られた事で、オファーサイドの出し残りは減少した。ターム物は、1～2W物のショートタームで▲0.04～▲0.035%のレンジで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(12/5-12/6)は▲0.09～▲0.08%程度、T/N(12/6-12/7)は▲0.10～▲0.09%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、20Y166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。アウトライト市場では、店頭見合いの買いからか3M物が▲0.235～▲0.20%で出合った。この他に、1Y物が▲0.155～▲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、鉱業で1,000億円超の大型案件が見られたことをはじめ、卸売やノンバンク等複数業態でまとまった額の調達が散見され、発行総額は4,100億円程度と償還総額の1,000億円程度を上回った。発行レートについては、大型案件においても上昇圧力は観測されず、0%近辺の低い水準で決着している。

●短期金融市場関連指標

2018/12/5	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				－	▲ 0.090
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.099
S/N							－	－
1W			▲ 0.038				－	▲ 0.106
2W			▲ 0.010				－	▲ 0.113
3W			▲ 0.035				－	▲ 0.129
1M							－	▲ 0.166
3M							▲ 0.235	▲ 0.159
6M							▲ 0.210	▲ 0.159
1Y							▲ 0.155	▲ 0.159

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.065	0.000	21,919.33	▲ 116.72	112.69-71	113.08-09

日付	11/28	11/29	11/30	12/3	12/4
日銀当預残	3,907,000	3,909,700	3,912,900	3,877,400	3,804,600
準備預金残	3,414,800	3,418,300	3,424,400	3,410,700	3,329,800
マネタリーベース	5,008,700	5,013,000	5,016,700	4,981,800	4,910,100
無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.072%	▲0.062%	▲0.069%	▲0.069%
コール市場残高	96,884	101,360	88,984	94,760	99,542
うち無担	78,868	81,763	69,361	66,414	72,531
うちO/N	47,078	49,033	38,691	37,124	42,961
うち有担	18,016	19,597	19,623	28,346	27,011

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
交付税特会	－	－	10,500	2018/12/13	2019/6/14	243,572.0	10,500.24		0.0000%	4.3110%		0.0000%	

●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）	4,500	2018/12/6			8,528	4,501	▲0.016		▲0.014	23.4
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,000	2018/12/6			5,181	2,009	▲0.012		▲0.010	59.5
国債買入（残存期間25年超）	500	2018/12/6			1,681	506	▲0.013		▲0.012	17.2
国債買入（物価連動債）	250	2018/12/6			1,223	253	▲0.120		▲0.141	88.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	113,440	2018/12/5	2018/12/6		908	908		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月6日の予定

*米国10月の貿易収支
*米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫

*国庫短期証券（800回）入札
（6ヶ月、23,000億円、12/10発行）

*流動性供給入札
（5,000億円、12/7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。
◆本資料は何ら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論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