Central Daily Market Report

2018年12月7日（金）
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7日 需給速報		2018年12月10日 需給予想		2018年12月11日 当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 700		▲ 1,000	
財政	1,000		▲ 15,900		2,000	
資金過不足	▲ 800		▲ 16,600		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			3,100	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	2,000	▲ 400		▲ 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						
ＥＴＦ買入			400			
国債補完供給	▲ 700	1,200		700		
当預増減	1,300		▲ 15,200		1,000	

当座預金残高	3,786,300	3,771,100	3,772,100
準備預金残高	3,351,800		
積み終了先	3,351,600	12月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,351,600	積数	1,000
非準備預金先	434,500	1日平均	200
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			3,011,600
準備預金進捗率	実績 99.97%	日数	80.00%

●2018年12月7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。週末要因による調達需要の増加なども見られず、出合い水準は昨日とほぼ同様となった。ターム物は、1～2W物のショートタームで▲0.04～▲0.03%のレンジで引き合いが散見された。

<レポ市場>
GC T+0(12/7-12/10)は▲0.09～▲0.08%程度、T/N(12/10-12/11)は▲0.09～▲0.08%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)は小幅上昇。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.165%から▲0.172%まで買い進まれ、▲0.175%の買い気配で引ける展開となる中、平均落札利回▲0.1753%、按分落札利回▲0.1675%と前回債からレートが小幅上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.177%から出合った後、▲0.20%まで買い進まれ、強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.175%、1Y物が▲0.168～▲0.165%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、卸売業で大ロットの発行があったものの、入札案件は2件のみと閑散で、発行総額は1,000億円弱と償還総額の1,300億円弱を下回った。発行レートは、発行残高が積み上がっている物で僅かに上昇したが、引き続き0%近辺の狭いレンジで決着している。

●短期金融市場関連指標

2018/12/7	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	▲ 0.067				－	▲ 0.088
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.093
S/N							－	－
1W	▲ 0.053	▲ 0.017	▲ 0.041				－	▲ 0.115
2W	▲ 0.047	▲ 0.035	▲ 0.041				－	▲ 0.127
3W							－	▲ 0.176
1M							－	▲ 0.184
3M							▲ 0.200	▲ 0.163
6M							▲ 0.175	▲ 0.159
1Y							▲ 0.164	▲ 0.161

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)
0.055	0.005	21,678.68	177.06	112.72-74	112.77-78

日付	11/30	12/3	12/4	12/5	12/6
日銀当預残	3,912,900	3,877,400	3,804,600	3,776,700	3,785,000
準備預金残	3,424,400	3,410,700	3,329,800	3,310,100	3,328,200
マネタリーベース	5,016,700	4,981,800	4,910,100	4,883,700	4,894,200
無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.069%	▲0.069%	▲0.069%	▲0.070%
コール市場残高	88,984	94,760	99,542	111,872	115,399
うち無担	69,361	66,414	72,531	76,574	82,221
うちO/N	38,691	37,124	42,961	46,904	52,096
うち有担	19,623	28,346	27,011	35,298	33,178

●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)
国庫短期証券	801	－	42,700	2018/12/10	2019/3/18	130,505.0	34,578.6	100.0450	▲0.1675%	42.2837%	100.0471	▲0.1753%	8,121.0
エネルギー対策	－	－	5,500	2018/12/20	2019/12/20	100,142.0	5,500.00		0.0000%	5.5586%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2018/12/10	2018/12/25		3,131	3,131				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	114,017	2018/12/7	2018/12/10		643	643		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月10日の予定

*7-9月期のGDP2次速報（市場予想：前期比年率▲1.9%）
*10月の国際収支
*11月の景気ウォッチャー調査

◆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