

Central Daily Market Report

2018年12月10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10日		2018年12月11日		2018年12月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,300		▲ 2,000	
財政	▲ 18,500		2,200		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 19,400		900		▲ 7,000	
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			12,300			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
E T F買入	400		400			
国債補完供給	▲ 500	700		500		
当預増減	▲ 18,500		13,900		▲ 7,000	
当座預金残高	3,767,800		3,781,700		3,774,700	
準備預金残高	3,311,600					
積み終了先	3,311,500		12月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,311,500		積数		900	
非準備預金先	456,200		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	83.33%		

●2018年12月10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。週末に積み最終日を控えているものの、調達サイドのスタンスには変化が無く、出合い水準は先週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引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(12/10-12/11)は▲0.09~▲0.08%程度、T/N(12/11-12/12)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。アウトライト市場は、店頭見合いの買いもあってか3M物が▲0.235~▲0.22%、6M物が▲0.189~▲0.18%の出合いと堅調に推移した。この他に、1Y物が▲0.169%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、その他金融業態で1,000億円を超える大型発行があったものの、案件数は少なく、発行総額1,900億円程度に対して、償還総額は2,600億円程度と償還超となった。発行レートは、引き続き0%近辺で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/12/10	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.085	0.035	▲ 0.020	21,219.50	▲ 459.18	112.52-54	112.63-64
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.037				-	▲ 0.117						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.138						
3W							-	▲ 0.215						
1M			0.360				-	▲ 0.207						
3M							▲ 0.230	▲ 0.165						
6M							▲ 0.189	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.161						
									日付	12/3	12/4	12/5	12/6	12/7
									日銀当預残	3,877,400	3,804,600	3,776,700	3,785,000	3,786,300
									準備預金残	3,410,700	3,329,800	3,310,100	3,328,200	3,352,000
									マネタリーベース	4,981,800	4,910,100	4,883,700	4,894,200	4,897,300
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.069%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.067%
									コール市場残高	94,760	99,542	111,872	115,399	104,462
									うち無担	66,414	72,531	76,574	82,221	78,525
									うちO/N	37,124	42,961	46,904	52,096	47,090
									うち有担	28,346	27,011	35,298	33,178	25,937

●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年超3年以下)	3,500	2018/12/11			8,478	3,503	0.002		0.004	45.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/12/11			9,633	4,005	▲0.010		▲0.009	81.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2018/12/11			12,805	4,504	▲0.019		▲0.017	75.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	168,879	2018/12/10	2018/12/11		422	422		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	35,787	2018/12/10	2018/12/11		93	93		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月11日の予定

*10月の特定サービス産業動態統計速報	*米11月の生産者物価指数	*30年利付国債入札(7,000億円、12/12発行)
*10-12月期の法人企業景気予測調査季報		
*11月のマネーストック		

◆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