

Central Daily Market Report

2018年12月11日(火)

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11日		2018年12月12日		2018年12月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 2,000		▲ 3,000	
財政	2,300		▲ 8,500		1,000	
資金過不足	900		▲ 10,500		▲ 2,000	
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	12,300					
CP等買入		▲ 200		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	400					
国債補完供給	▲ 3,600	500		3,600		
当預増減	10,300		▲ 6,500		▲ 2,000	
当座預金残高	3,778,100		3,771,600		3,769,600	
準備預金残高	3,347,600					
積み終了先	3,347,500				12月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,347,500				積数	
非準備預金先	430,500				1日平均	
					700	
					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		99.98%		日数	
					86.67%	

●2018年12月11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。いくつかの業態からは積みの最終日に向けて堅調な調達が見られているものの、レートが上昇するほどの需要はなく、出会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引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(12/11-12/12)は▲0.085~▲0.08%程度、T/N(12/12-12/13)は▲0.09~▲0.08%程度で出会いが見られた。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10Y335~352や、5Y133~137、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、短国買入オペが1,000億円(前回と同額)でオファーされた。引き続き買入額が少額にとどまる中、按分落札利回較差+0.002%、平均落札利回較差+0.002%と落ち着いた結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.23%、6M物が▲0.186~▲0.185%、1Y物が▲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、建設・不動産業態でまとまった調達があり、償還総額1,800億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と若干の発行超となった。発行レートは、引き続き0%近辺で推移した。本日はCP等買入オペがオファー額2,000億円を実施された。結果は平均・按分落札レートが共に▲0.002%となり、前回比(平均0.001%・按分▲0.002%)で平均レートが低下、按分レートが横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/11	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	0.040	0.005	21,148.02	▲ 71.48	113.19-20	113.11-12
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.040				-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.124						
2W							-	▲ 0.144						
3W							-	▲ 0.250						
1M							-	▲ 0.243						
3M							▲ 0.224	▲ 0.169						
6M							▲ 0.185	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.161						
									日付	12/4	12/5	12/6	12/7	12/10
									日銀当預残	3,804,600	3,776,700	3,785,000	3,786,300	3,767,800
									準備預金残	3,329,800	3,310,100	3,328,200	3,352,000	3,311,600
									マネタリーベース	4,910,100	4,883,700	4,894,200	4,897,300	4,879,700
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.069%	▲0.070%	▲0.067%	▲0.068%
									コール市場残高	99,542	111,872	115,399	104,462	114,667
									うち無担	72,531	76,574	82,221	78,525	84,804
									うちO/N	42,961	46,904	52,096	47,090	52,689
									うち有担	27,011	35,298	33,178	25,937	29,863

●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1非価格競争入札(億円)
30年利付国債	60	0.90%	7,000	2018/12/12	2048/9/20	21,386.0	5,657.00	102.5000	0.7960%	82.4455%	102.5500	0.7940%	1,335.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2018/12/12			5,955	1,001	0.002		0.002	98.2
CP等買入	2,000	2018/12/14			5,620	1,980	▲0.002		▲0.002	42.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	184,451	2018/12/11	2018/12/12		3,427	3,427		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/12/13	2018/12/20	2.7		3				

●2018年12月12日の予定

*10月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比：+10.5%)	*米国11月の消費者物価指数
*11月の企業物価指数	*米国11月の財政収支

◆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