

Central Daily Market Report

2018年12月13日(木)

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13日		2018年12月14日		2018年12月17日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	▲ 3,100		▲ 2,800		▲ 2,000		
財政	4,400		53,100		11,000		
資金過不足	1,300		50,300		9,000		
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							▲ 1,900
国債売現							
国庫短期証買入							
国債買入							
CP等買入		▲ 400	2,000	▲ 1,000			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)			17,400	▲ 23,700			
被災地支援 社債等買入							
E T F買入	700						
国債補完供給	▲ 600	600		600			
当預増減	1,600		45,600		7,100		
当座預金残高	3,773,300		3,818,900		3,826,000		
準備預金残高	3,382,300		3,382,200		3,382,200		
積み終了先	3,382,200		3,382,100		3,382,100		
超過準備	3,382,100		3,382,100		3,382,100		
非準備預金先	391,000		391,000		391,000		
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		
					93.33%		

●2018年12月13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▲0.085~▲0.03%の調達で始まった。実質的な積み最終日を明日に控え、昨日に引き続き各業態から堅調な調達ニーズが見られた。一巡後はビッドが徐々に減少し、▲0.086~▲0.08%近辺で散発的な出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。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(12/13-12/14)は▲0.09~▲0.08%程度、T/N(12/14-12/17)は▲0.17~▲0.14%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、30Y59などにビッドが目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は低下した。アウトライト市場は、翌日に3M物の入札を控え動意なく閑散な中、6M物が▲0.19~▲0.185%、1Y物が▲0.175~▲0.17%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、電気機器業態1社で1,000億円を越える大型発行が実施された。償還総額2,600億円程度に対して、発行総額は3,500億円程度と発行超のマーケットとなった。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

2018/12/13	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	▲0.062				-	▲0.083	0.050	0.000	21,816.19	213.44	113.28-30	113.39-40
T/N	▲0.045	▲0.015	▲0.033				-	▲0.151						
S/N							-	-						
1W	▲0.025	0.001	▲0.019				-	▲0.169						
2W	▲0.040	▲0.038	▲0.039				-	▲0.182						
3W							-	▲0.300						
1M	▲0.035	▲0.025	▲0.026				-	▲0.278						
3M							▲0.240	▲0.174						
6M							▲0.190	▲0.163						
1Y							▲0.175	▲0.164						
日付		12/6	12/7	12/10	12/11	12/12								
日銀当預残		3,785,000	3,786,300	3,767,800	3,778,100	3,771,700								
準備預金残		3,328,200	3,352,000	3,311,600	3,348,300	3,359,900								
マネタリーベース		4,894,200	4,897,300	4,879,700	4,891,400	4,887,100								
無担O/N加重平均		▲0.070%	▲0.067%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.066%								
コール市場残高		115,399	104,462	114,667	121,554	120,720								
うち無担		82,221	78,525	84,804	91,167	90,291								
うちO/N		52,096	47,090	52,689	58,952	58,476								
うち有担		33,178	25,937	29,863	30,387	30,429								

●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)
5年利付国債	137	0.10%	20,000	2018/12/14	2023/9/20	63,263.0	16,477.00	101.0000	▲0.1080%	13.0155%	101.0200	▲0.1120%	3,518.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/12/21	2019/6/21	233,949.0	10,500.03		0.0000%	4.5113%		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	申込総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	149,027	2018/12/13	2018/12/14		538	538		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月14日の予定

*10月の第3次産業活動指数	*米国10月の企業在庫	*国庫短期証券(802回)入札(3ヶ月、43,200億円、12/17発行)
*12月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国11月の小売売上高	
市場予想: 大企業・製造業の業況判断指数(DI): +17	*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率	

◆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いますが、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り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