

Central Daily Market Report

2018年12月14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14日		2018年12月17日		2018年12月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 1,700		▲ 3,000	
財政	51,400		10,400		2,000	
資金過不足	48,700		8,700		▲ 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			1,900	▲ 1,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,000			
CP等買入	2,000	▲ 1,000		▲ 400		
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			1,700			
国債補完供給	▲ 700	600		700		
当預増減	43,300		17,700		▲ 1,000	
当座預金残高	3,816,600		3,834,300		3,833,300	
準備預金残高	3,326,300					
積み終了先	3,326,300				12月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,326,100				積数 630,700	
非準備預金先	490,300				1日平均 21,000	
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額					3,124,000	
準備預金進捗率	実績		79.81%		日数 3.23%	

●2018年12月14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~▲0.03%の調達で始まった。本質的な積み最終日にあたるため、一部では積極的に調達を行う先も見られた。しかし、年金定時払いによる資金余剰要因や、休日の関係で来積み期にも一部掛かる取引となることから、全体的には資金調達ニーズは限定的で、オファーサイドには出し残りも発生した。一巡後は▲0.086~▲0.05%近辺で散発的な出合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(12/14-12/17)は▲0.11~▲0.09%程度、T/N(12/17-12/18)は▲0.20~▲0.17%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。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.19%から▲0.22%まで買い進まれる展開となる中、平均落札利回▲0.2125%、按分落札利回▲0.2010%と前回債からレートが低下する結果となった。セカンダリーでは、▲0.26~▲0.24%出合いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.175%で出合った後、引け際に▲0.195~▲0.19%で出合いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、案件が少なく閑散としたマーケットとなり、発行総額200億円程度に対して、償還総額は1,200億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

2018/12/14	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	▲ 0.065				-	▲ 0.103	0.030	▲ 0.020	21,374.83	▲ 441.36	113.56-58	113.55-56
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.187						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.191						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.310						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.320						
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.301						
3M							▲ 0.240	▲ 0.177						
6M							▲ 0.191	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.191	▲ 0.164						
									日付	12/7	12/10	12/11	12/12	12/13
									日銀当預残	3,786,300	3,767,800	3,778,100	3,771,700	3,773,300
									準備預金残	3,352,000	3,311,600	3,348,300	3,359,900	3,382,300
									マネタリーベース	4,897,300	4,879,700	4,891,400	4,887,100	4,891,800
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%
									コール市場残高	104,462	114,667	121,554	120,720	115,869
									うち無担	78,525	84,804	91,167	90,291	85,894
									うちO/N	47,090	52,689	58,952	58,476	54,209
									うち有担	25,937	29,863	30,387	30,429	29,975

●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)
国庫短期証券	802	-	43,200	2018/12/17	2019/3/25	142,030.4	35,082.8	100.0540	▲0.2010%	73.9027%	100.0571	▲0.2125%	8,117.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2018/12/17	2019/1/8		1,945	1,945				
国債買入(残存期間5年起10年以下)	4,300	2018/12/17			9,383	4,307	▲0.013		▲0.011	13.3
国債買入(残存期間10年起25年以下)	2,000	2018/12/17			3,638	2,003	▲0.007		▲0.004	92.3
国債買入(残存期間25年起)	500	2018/12/17			1,149	502	0.001		0.002	27.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,911	2018/12/14	2018/12/17		663	663		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月17日の予定

*10月の石油等消費動態統計	*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値
----------------	---------------------

◆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