Central Daily Market Report

2018年12月18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18日 需給速報	2018年12月19日 需給予想	2018年12月20日 当社予想
銀行券	▲ 2,700	▲ 2,900	▲ 5,000
財政	▲ 1,400	▲ 9,300	75,000
資金過不足	▲ 4,100	▲ 12,200	70,000

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	8,600					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 1,100	1,200		1,100		
当預増減	4,100		▲ 10,200		70,000	

当座預金残高	3,837,200	3,827,000	3,897,000
準備預金残高	3,321,700		
積み終了先	3,288,300		
超過準備	3,265,200		
非準備預金先	515,500		

12月19日以降の残り所要積立額	
積数	65,900
1日平均	2,400

積み期間（12/16～1/15）の所要準備額			3,120,800
準備預金進捗率	実績	97.89%	日数 9.68%

●2018年12月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀を中心に▲0.086～▲0.035%の幅広いレンジでの調達で始まった。引き続き調達意欲は弱く、一巡後も閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は月内ショートターム物を中心に、▲0.04%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(12/18-12/19)は▲0.250～▲0.200%程度、T/N(12/19-12/20)は▲0.210～▲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、5Y130～137、20Y164～166、30Y57～60などカレント近辺の銘柄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、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、全取落札利回較差＋0.160%、平均落札利回較差＋0.160%と市場の想定外の結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.275～▲0.26%、1Y物が▲0.20～▲0.198%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、20日発行の応当日にあたり幅広い業態からの発行案件が見られ、発行総額は3,400億円程度まで膨らんだ（償還総額3,000億円程度）。発行レートは0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/18	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	▲ 0.068				－	▲ 0.191
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.205
S/N							－	－
1W	▲ 0.045	▲ 0.018	▲ 0.028				－	▲ 0.219
2W							－	▲ 0.362
3W			▲ 0.028				－	▲ 0.330
1M							－	▲ 0.313
3M							▲ 0.275	▲ 0.181
6M							▲ 0.205	▲ 0.164
1Y							▲ 0.185	▲ 0.164

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）
0.025	▲ 0.005	21,115.45	▲ 391.43	112.83-84	112.51-53

日付	12/11	12/12	12/13	12/14	12/17
日銀当預残	3,778,100	3,771,700	3,773,300	3,816,600	3,833,100
準備預金残	3,348,300	3,359,900	3,382,300	3,327,200	3,332,700
マネタリーベース	4,891,400	4,887,100	4,891,800	4,937,800	4,956,100
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%	▲0.065%	▲0.067%
コール市場残高	121,554	120,720	115,869	97,806	87,916
うち無担	91,167	90,291	85,894	74,800	75,564
うちO/N	58,952	58,476	54,209	45,535	44,649
うち有担	30,387	30,429	29,975	23,006	12,352

●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)
20年利付国債	166	0.70%	10,000	2018/12/19	2038/9/20	27,813.0	8,078.00	102.7500	**0.5450%**	**65.7187%**	102.8000	**0.5430%**	1,913.0

●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	2018/12/19			2,791	1,000		0.160	0.160	
社債等買入	750	2018/12/25			3,050	751	0.042		0.081	75.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	95,719	2018/12/18	2018/12/19		996	996		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2018/12/18	2018/12/19		100	100		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2018/12/20	2019/1/10	2.86	10	10				

●2018年12月19日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（1日目、20日まで）
*11月の貿易統計
*米国FOMC（2日目）
*米国FRB経済見通し発表
*米国11月の中古住宅販売
*英国11月の消費者物価指数
*国庫短期証券（803回）入札
（1年、21,000億円、12/20発行）

◆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