

Central Daily Market Report

2018年12月19日(水)

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19日		2018年12月20日		2018年12月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,000		▲ 4,000		▲ 4,000	
財政	▲ 9,700		70,500		2,000	
資金過不足	▲ 12,700		66,500		▲ 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			5,200			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 100
社債等買入				▲ 400		
E T F買入						
国債補充供給	▲ 200	1,100		200		
当預増減	▲ 10,900		71,300		▲ 2,000	
当座預金残高	3,826,300		3,897,600		3,895,600	
準備預金残高	3,330,500					
積み終了先	3,311,400				12月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,306,300				積数 41,700	
非準備預金先	495,800				1日平均 1,500	
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		98.66%		日数 12.90%	

●2018年12月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き国内勢を中心に▲0.086~▲0.035%近辺の調達で始まった。調達姿勢は慎重で取り急ぐ動きは見られず、一巡後も閑散とした中で本日の取引を終えた。ターム物は小幅低下基調で、月内物では▲0.045%近辺の運用ニーズが複数見られた。

<レポ市場>

GC T+0(12/19-12/20)は▲0.200~▲0.150%程度、T/N(12/20-12/21)は▲0.210~▲0.180%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、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)は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.175~▲0.165%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1697%、按分落札利回▲0.1527%と平均レートは前回から低下したものの、按分レートが流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.17~▲0.16%での出会いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.305%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。石油、鉄鋼、ノンバンク業態から大型案件が見られ、発行総額は3,000億円程度まで膨らんだものの、償還総額は4,500億円程度と償還超であった。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

2018/12/19	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	▲ 0.070				-	▲ 0.174	0.030	0.005	20,987.92	▲ 127.53	112.51-53	112.40-41
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.201						
S/N			▲ 0.086				-	-						
1W	▲ 0.052	▲ 0.018	▲ 0.030				-	▲ 0.218						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.346						
3W							-	▲ 0.315						
1M							-	▲ 0.292						
3M							▲ 0.305	▲ 0.180						
6M							▲ 0.190	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.163						
									日付	12/12	12/13	12/14	12/17	12/18
									日銀当預残	3,771,700	3,773,300	3,816,600	3,833,100	3,837,200
									準備預金残	3,359,900	3,382,300	3,327,200	3,332,700	3,321,700
									マネタリーベース	4,887,100	4,891,800	4,937,800	4,956,100	4,962,900
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.062%	▲0.065%	▲0.067%	▲0.068%
									コール市場残高	120,720	115,869	97,806	87,916	85,879
									うち無担	90,291	85,894	74,800	75,564	74,655
									うちO/N	58,476	54,209	45,535	44,649	41,360
									うち有担	30,429	29,975	23,006	12,352	11,224

●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	803	-	21,000	2018/12/20	2019/12/20	75,629.0	17,235.9	100.1530	▲0.1527%	43.8461%	100.1700	▲0.1697%	3,764.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/12/20			807	501	0.000		0.001	99.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,300	2018/12/20			12,562	4,306	▲0.018		▲0.016	97.2
国債買入(物価連動債)	250	2018/12/20			1,690	251	▲0.410		▲0.446	95.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	73,639	2018/12/19	2018/12/20		145	145		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	17,442	2018/12/19	2018/12/20		65	65		▲0.600	▲0.600	
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)					
被災地金融支援オペ	第92回	2018/12/21	2019/12/20	0	71					
被災地金融支援オペ(熊本)	第31回	2018/12/21	2019/12/20	0	0					

●2018年12月20日の予定

*月例経済報告	*英中銀MPC結果発表
*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	
*黒田日銀総裁、定例会見	

◆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