

Central Daily Market Report

2018年12月21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21日		2018年12月25日		2018年12月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 4,700		▲ 3,000		▲ 3,000	
財政	3,100		▲ 100		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 1,600		▲ 3,100		▲ 5,000	
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			5,500	▲ 3,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 800		▲ 800		
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			800	▲ 100		
E T F買入			2,500			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	▲ 2,500		1,900		▲ 5,000	
当座預金残高	3,896,200		3,898,100		3,893,100	
準備預金残高	3,371,300					
積み終了先	3,370,900				12月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,367,500				積数 8,800	
非準備預金先	524,900				1日平均 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	99.72%	日数	29.03%		

●2018年12月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀勢を中心に▲0.086~▲0.045%の調達希望で始まった。連休を控えた警戒感から調達需要は低調で、出合いの水準は一段と低下。一巡後も閑散であった。ターム物もレート低下基調で、月内物では▲0.070~▲0.050%の出しニーズがみられたが、調達サイドが落ち着いていることもあり、出合いはみられなかった。

<レポ市場>

GC T+0(12/21-12/25)は▲0.200~▲0.100%程度、T/N(12/25-12/26)は▲0.150~▲0.100%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)は上昇した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。今回の入札は償還日が年度末越えとなることから一定のニーズも見込まれ、WI取引において▲0.22%から▲0.25%まで買い進まれる展開となったものの、平均落札利回▲0.2053%、按分落札利回▲0.1751%と前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.19~▲0.18%での出合いと按分レート近辺で推移した。この他に、1Y物が▲0.18~▲0.175%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、鉄鋼、建設、ノンバンク業態から大型案件が見られ、発行総額は2,400億円程度まで膨らんだものの、償還総額は3,500億円程度と償還超であった。発行レートは引き続き0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/21	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	▲ 0.071				-	▲ 0.156	0.035	0.010	20,166.19	▲ 226.39	111.17-18	111.26-27
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.155						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.035	▲ 0.055				-	▲ 0.250						
2W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.035				-	▲ 0.231						
3W	▲ 0.017	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.209						
1M							-	▲ 0.197						
3M							▲ 0.180	▲ 0.174						
6M							▲ 0.190	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.163						
									日付	12/14	12/17	12/18	12/19	12/20
									日銀当預残	3,816,600	3,833,100	3,837,200	3,826,300	3,898,700
									準備預金残	3,327,200	3,332,700	3,321,700	3,329,100	3,376,400
									マネタリーベース	4,937,800	4,956,100	4,962,900	4,955,000	5,031,600
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.067%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.071%
									コール市場残高	97,806	87,916	85,879	87,704	89,238
									うち無担	74,800	75,564	74,655	76,253	78,048
									うちO/N	45,535	44,649	41,360	42,418	42,463
									うち有担	23,006	12,352	11,224	11,451	11,190

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	804	-	42,700	2018/12/25	2019/4/4	119,409.4	34,727.8	100.0480	▲0.1751%	71.1916%	100.0563	▲0.2053%	7,972.0
流動性供給	276	-	6,000	2018/12/25		18,649.0	5,981.0		0.0190%	19.3283%		0.0150%	

●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	入札総額(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	2018/12/25	2019/1/15		5,466	5,466				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	54,592	2018/12/21	2018/12/25		183	183		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月25日の予定

*クリスマス	*New York、EURO、London祝日(Christmas Day)
*10月の景気動向指数改訂状況	
*11月の企業向けサービス価格指数	

◆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