

Central Daily Market Report

2018年12月25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25日		2018年12月26日		2018年12月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,200		▲ 3,600		▲ 4,000	
財政	1,100		600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 3,000		▲ 6,000	
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			10,500			
CP等買入		▲ 800		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800	▲ 100				
E T F買入	2,500					
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当増増減	2,700		7,200		▲ 6,000	
当座預金残高	3,898,900		3,906,100		3,900,100	
準備預金残高	3,392,300					
積み終了先	3,391,900				12月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,391,900				積数	
非準備預金先	506,600				1日平均	
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		99.73%		日数	
					32.26%	

●2018年12月25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~▲0.045%の出会いで始まった。先週に引き続き調達姿勢は慎重で、一巡後は同水準で散発的な出会いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物は期末要因により動きが乏しく、月内ショートターム物で数件の出会いが見られる程度だった。

<レポ市場>

GC T+0(12/25-12/26)は▲0.120~▲0.090%程度、T/N(12/26-12/27)は▲0.130~▲0.100%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。アウトライト市場は、海外勢がクリスマス休暇に入って動意なく閑散な中、引け際に1Y物が▲0.18%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏での推移。CP発行市場は、石油・鉄鋼・ノンバンクから大型発行が見られ、発行・償還ともに4,000億円程度の規模であった。発行レートに目立った変化は見られなかった。また、今期最後となるCP等買入オベが2,000億円でオファーされ、平均落札レート0.003%、按分落札レート▲0.001%といずれも前回比で上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/25	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	▲ 0.070				-	▲ 0.101	0.010	▲ 0.025	19,155.74	▲ 1010.45	110.29-33	110.24-29
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.210						
2W							-	▲ 0.187						
3W							-	▲ 0.177						
1M			▲ 0.017				-	▲ 0.173						
3M							▲ 0.180	▲ 0.170						
6M							▲ 0.190	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.163						
									日付	12/17	12/18	12/19	12/20	12/21
									日銀当預残	3,833,100	3,837,200	3,826,300	3,898,700	3,896,200
									準備預金残	3,332,700	3,321,700	3,329,100	3,376,400	3,371,400
									マネタリーベース	4,956,100	4,962,900	4,955,000	5,031,600	5,033,800
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.068%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%
									コール市場残高	87,916	85,879	87,704	89,238	88,547
									うち無担	75,564	74,655	76,253	78,048	76,152
									うちO/N	44,649	41,360	42,418	42,463	39,807
									うち有担	12,352	11,224	11,451	11,190	12,395

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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年超3年以下)	3,500	2018/12/26			8,024	3,503	▲0.009		▲0.006	35.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/12/26			10,237	4,003	▲0.022		▲0.019	66.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2018/12/26			5,355	2,004	▲0.039		▲0.034	24.7
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/12/26			1,222	502	▲0.048		▲0.040	36.0
CP等買入	2,000	2018/12/28			6,927	1,967	▲0.001		0.003	45.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	72,669	2018/12/25	2018/12/26		163	163		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月26日の予定

*黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議委員会において講演	*EURO祝日(Christmas Holiday)	*2年利付国債入札(21,000億円、1/4発行)
*金融政策決定会合議事要旨(10月30、31日分)	*London祝日(Boxing Day)	
	*10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	

◆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