

Central Daily Market Report

2018年12月26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26日		2018年12月27日		2018年12月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,700		▲ 4,900		▲ 600	
財政	▲ 3,400		▲ 5,000		▲ 2,900	
資金過不足	▲ 7,100		▲ 9,900		▲ 3,500	
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	10,500					
CP等買入		▲ 500		▲ 600	2,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 400	200		400		
当預増減	2,700		▲ 9,100		▲ 1,500	
当座預金残高	3,901,600		3,892,500		3,891,000	
準備預金残高	3,397,800					
積み終了先	3,397,500				12月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,397,500				積数 8,100	
非準備預金先	503,800				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	99.74%	日数	35.48%		

●2018年12月26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、前日比横ばいの▲0.086~▲0.045%の調達希望で始まった。引き続き調達姿勢は慎重で、一巡後は同水準の出合いが散見された。ターム物は月末要因につき様子見閑散であった。

<レポ市場>

GC T+0(12/26-12/27)は▲0.100~▲0.090%程度、T/N(12/27-12/28)は▲0.120~▲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、按分落札利回較差+0.060%、平均落札利回較差+0.069%と、引け値が低い銘柄の在庫調整の売りから弱い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.1725%、1Y物が▲0.175%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、期末発行にあたり案件数も多く、幅広い業態から大型案件が実施され活況なマーケットとなった。しかし年末償還銘柄の残高が大きく、発行総額1兆2,000億円程度に対して、償還総額は3兆5,000億円程度と例年と同様に大幅な償還超となった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/26	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	0.018	0.008	19,327.06	171.32	110.42-45	110.42-43
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.200						
2W			0.010				-	▲ 0.180						
3W							-	▲ 0.169						
1M	▲ 0.017	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.163						
3M			0.200				▲ 0.170	▲ 0.165						
6M							▲ 0.190	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.163						
									日付	12/18	12/19	12/20	12/21	12/25
									日銀当預残	3,837,200	3,826,300	3,898,700	3,896,200	3,898,900
									準備預金残	3,321,700	3,329,100	3,376,400	3,371,400	3,392,300
									マネタリーベース	4,962,900	4,955,000	5,031,600	5,033,800	5,039,700
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%
									コール市場残高	85,879	87,704	89,238	88,547	93,383
									うち無担	74,655	76,253	78,048	76,152	72,036
									うちO/N	41,360	42,418	42,463	39,807	36,021
									うち有担	11,224	11,451	11,190	12,395	21,347

●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)
2年利付国債	396	0.10%	21,000	2019/1/4	2021/1/1	92,876.0	17,328.00	100.4500	▲0.1250%	65.5555%	100.4540	▲0.1270%	3,665.0

●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	2018/12/27			9,411	1,002	0.060		0.069	44.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	70,252	2018/12/26	2018/12/27		426	426		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月27日の予定

*11月の住宅着工統計	*米国11月の新築一戸建て販売件数
	*米国12月のCB消費者信頼感指数

◆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