

# Central Daily Market Report

2018年12月27日(木)

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27日		2018年12月28日		2019年1月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 5,000		▲ 2,600		6,000	
財政	▲ 5,700		▲ 4,800		▲ 19,000	
資金過不足	▲ 10,700		▲ 7,400		▲ 13,000	
<b>金融調節</b>	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			7,100			
CP等買入		▲ 600	2,000	▲ 3,300		
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			700			
国債補完供給		400				
当預増減	▲ 9,900		▲ 900		▲ 13,000	
当座預金残高	3,891,700		3,890,800		3,877,800	
準備預金残高	3,385,100					
積み終了先	3,384,900				12月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,384,900				積数	7,800
非準備預金先	506,600				1日平均	400
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額						3,120,700
準備預金進捗率	実績	99.75%	日数	38.71%		

## ●2018年12月27日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.086~▲0.045%の調達で始まった。引き続き低調な地合いとなり、一巡後は▲0.08%近辺の出会いが散見された。ターム物は、年明けスタートのショートターム物を中心に、複数出会いが見られた。

### <レポ市場>

GC T+0(12/27-12/28)は▲0.120~▲0.090%程度、T/N(12/28-1/4)は▲0.110~▲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)は小幅上昇。アウトライト市場は、年末を控えて動意なく閑散な中、3M物が▲0.16~▲0.135%、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、年初の発行にあたり、償還総額は400億円弱と少額であったが、商社・鉄鋼・機械等の幅広い業態が大型発行を実施したため、発行総額は7,000億円強に膨らんだ。発行レートに目立った変化はなく、0%付近での決着が中心であった。

## ●短期金融市場関連指標

2018/12/27	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.101	0.020	0.002	20,077.62	750.56	111.20-22	110.93-94
T/N			▲ 0.086				-	▲ 0.121						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.127						
2W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.031				-	▲ 0.131						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.135						
1M			0.040				-	▲ 0.143						
3M							▲ 0.160	▲ 0.153						
6M							▲ 0.190	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.161						
									日付	12/19	12/20	12/21	12/25	12/26
									日銀当預残	3,826,300	3,898,700	3,896,200	3,898,900	3,901,600
									準備預金残	3,329,100	3,376,400	3,371,400	3,392,300	3,397,900
									マネタリーベース	4,955,000	5,031,600	5,033,800	5,039,700	5,046,100
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.070%
									コール市場残高	87,704	89,238	88,547	93,383	92,482
									うち無担	76,253	78,048	76,152	72,036	71,070
									うちO/N	42,418	42,463	39,807	36,021	34,855
									うち有担	11,451	11,190	12,395	21,347	21,412

## ●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	応募総額(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5年超10年以下)	4,300	2018/12/28			7,622	4,307	0.000		0.002	45.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2018/12/28			3,913	2,007	0.005		0.006	89.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/12/28			1,651	503	0.016		0.017	37.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	13,518	2018/12/27	2018/12/28		47	47		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年12月28日の予定

*決定会合における主な意見(12月19、20日分)	*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.9%)
*11月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*11月の商業動態統計速報
*11月の有効求人倍率(市場予想:1.63倍)	*12月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.9%)

◆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