

Central Daily Market Report

2018年12月28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28日		2019年1月4日		2019年1月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,600		6,100		6,000	
財政	▲ 3,400		▲ 23,900		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 6,000		▲ 17,800		▲ 1,000	
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						
国債買入	7,100					
CP等買入	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	▲ 700		700			
当預増減	▲ 200		▲ 17,100		▲ 1,000	
当座預金残高	3,891,500		3,874,400		3,873,400	
準備預金残高	3,376,900					
積み終了先	3,376,700		1月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,376,100		積数	2,200		
非準備預金先	514,600		1日平均	200		
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額					3,118,200	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	61.29%		

●2018年12月28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。四半期末の取引となったため、調達を控える先が多く閑散であった。ターム物は年明けスタートのショートターム物で出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T+0(12/28-1/4)は▲0.100~▲0.095%程度、T/N(1/4-1/7)は▲0.095~▲0.090%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、年内最終営業日で受渡が新年となったものの、参加者が少なく、足元ファンディングレートの上昇や年明けの入札ラッシュから様子見姿勢が強まった。出合いは、引け際に3M物が▲0.15%で出合ったのみだった。

<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、2,900億円程度の償還に対して、4,200億円強の発行となり、鉄鋼・機械等がまとまったロットでの発行を実施した。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/28	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	▲ 0.054				-	▲ 0.098	▲ 0.004	▲ 0.024	20,014.77	▲ 62.85	110.84-85	110.39-41
T/N	▲ 0.086	▲ 0.020	▲ 0.075				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.048				-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.120						
1M	0.360	0.480	0.420				-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.153	▲ 0.153						
6M							▲ 0.190	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.180	▲ 0.159						
									日付	12/20	12/21	12/25	12/26	12/27
									日銀当預残	3,898,700	3,896,200	3,898,900	3,901,600	3,891,700
									準備預金残	3,376,400	3,371,400	3,392,300	3,397,900	3,386,100
									マネタリーベース	5,031,600	5,033,800	5,039,700	5,046,100	5,041,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.070%	▲ 0.070%
									コール市場残高	89,238	88,547	93,383	92,482	87,640
									うち無担	78,048	76,152	72,036	71,070	72,009
									うちO/N	42,463	39,807	36,021	34,855	36,714
									うち有担	11,190	12,395	21,347	21,412	15,631

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	43,518	2018/12/28	2019/1/4		642	642		▲0.600	▲0.600	

●2019年1月3日の予定

*米国11月の建設支出	*米国12月のISM製造業景況指数
-------------	-------------------

●2019年1月4日の予定

*証券取引所大発表	*米国12月の雇用統計	*ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値
-----------	-------------	---------------------

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願ひ申し上げます。

◆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