

Central Daily Market Report

2017年12月6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	2017年12月6日		2017年12月7日		2017年12月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 2,700		▲ 2,000	
財政	▲ 1,400		8,300		3,000	
資金過不足	▲ 2,900		5,600		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					4,600	
CP等買入		▲ 600		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入			100			
国債補完供給	▲ 800	100		800		
当預増減	▲ 4,200		6,200		5,600	
当座預金残高	3,583,100		3,589,300		3,594,900	
準備預金残高	3,162,500					
積み終了先	3,161,800				12月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,161,800				積数	3,100
非準備預金先	420,600				1日平均	300
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額						2,946,100
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	70.00%		

●2017年12月6日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比2兆6,000億円減の316兆9,000億円(当座預金残高は358兆4,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・外銀・証券業態より▲0.050~▲0.030%のレンジでの出会いとなった。一巡後は調整から▲0.060~▲0.055%の出会いが見られた程度であった。大手証券より大規模な試し取りが実施されたため、全体的にレートを切り上げて調達に動く先が散見された。ターム物に関しては特段目立った出会いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(12/7-12/8)は、▲0.080~▲0.07%程度での出会い。S/N(12/8-12/11)は、▲0.080~▲0.060%程度で出会い。引き続きオファーサイドの資金調達ニーズが厚く入り、上昇しながらの推移となった。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、2Y381・382、5Y130~133、10Y336~348、30Y51~56などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は、6M(725回)の入札が実施された。今回の入札は、先週末から軟調地合いが続いており、レートの上昇も予想された。WI取引において▲0.145%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1442%、按分落札利回▲0.1382%と順調な結果となった。セカンダリーでは、▲0.15%での出会いが見られ、堅調に推移した。その他には、3M物が▲0.148~▲0.1475%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。CP発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は3,000億円強と発行超であった。5・10日の前倒し発行となり、一部の石油・ゴム製品・卸売業態において大型案件が見られ、月の初旬としては多めの発行量であった。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オペアが4,000億円オファーされた。オファー額が増加したものの、入札結果は平均落札レート0.001%・按分レート▲0.002%と、前回(平均0.000%・按分▲0.001%)比で特段の変動はなかった。

●短期金融市場関連指標

2017/12/6	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.082	0.050	▲ 0.005	22,177.04	▲ 445.34	112.46-47	112.10-11
T/N	▲ 0.020	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.091						
3W			0.001				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.150	▲ 0.126						
6M							▲ 0.150	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.161						
									日付	11/29	11/30	12/1	12/4	12/5
									日銀当預残	3,646,000	3,648,200	3,643,100	3,565,100	3,587,300
									準備預金残	3,227,600	3,212,300	3,230,500	3,170,800	3,185,400
									マネタリーベース	4,712,100	4,715,600	4,712,200	4,634,800	4,658,300
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.055%	▲0.056%	▲0.052%	▲0.050%
									コール市場残高	98,321	89,180	100,770	94,087	101,101
									うち無担	74,886	65,651	76,312	71,027	77,835
									うちO/N	44,281	37,776	47,767	43,242	49,650
									うち有担	23,435	23,529	24,458	23,060	23,266

●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)
国庫短期証券	725	-	23,000	2017/12/11	2018/6/11	97,329.0	18,687.9	100.0690	▲0.1382%	51.8928%	100.0720	▲0.1442%	4,312.0
交付税特会	-	-	10,500	2017/12/14	2018/6/14	183,786.0	10,500.07		0.0000%	5.7133%		0.0000%	

●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年以下)	500	2017/12/8			2,929	501	0.022		0.024	84.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/12/8			15,082	4,107	0.001		0.001	79.5
CP等買入	4,000	2017/12/11			9,624	3,985	▲0.002		0.001	51.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	51,644	2017/12/6	2017/12/7		761	761		▲0.600	▲0.600	

●2017年12月7日の予定

*10月の景気動向指数速報	*米国10月の消費者信用残高	*国庫短期証券(726回)入札(3ヶ月、44,000億円、12/11発行)
*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*ユーロ圏7-9月期のGDP確報値	*30年利付国債入札(8,000億円、12/20発行)

◆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