

Central Daily Market Report

2017年12月7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	2017年12月7日		2017年12月8日		2017年12月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 2,100		▲ 1,000	
財政	7,000		6,000		▲ 4,000	
資金過不足	4,300		3,900		▲ 5,000	
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					3,000	▲ 2,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 200	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
ETF買入	100		200			
国債補完供給	▲ 500	800		500		
当預増減	4,400		9,000		▲ 200	
当座預金残高	3,587,500		3,596,500		3,596,300	
準備預金残高	3,183,400					
積み終了先	3,182,900				12月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,182,800				積数 2,500	
非準備預金先	404,100				1日平均 300	
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額					2,950,300	
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数	73.33%		

●2017年12月7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1兆8,000億円増の318兆7,000億円(当座預金残高は358兆9,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・外銀・証券業態より▲0.060~▲0.040%の出合いとなった。試し取り要因が剥落したものの、税揚げ以降の流れが続いており、地銀業態を中心に資金調達ニーズは堅調で、一巡後も▲0.060~▲0.035%の間で出合いが散見された。ターム物に関しては特段目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(12/8-12/11)は、▲0.080~▲0.065%程度での出合い。S/N(12/11-12/12)は、▲0.065~▲0.055%程度で出合い。S/Nは短国の発行が重なったことから、資金調達ニーズが一段と厚く見られ、レートも上昇しての推移となった。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、3M(726回)の入札が実施された。WI取引において▲0.155~▲0.15%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1522%、按分落札利回▲0.1414%としっかりした結果となった。セカンダリーでは、▲0.148%で少額の出合いと底堅く推移した。その他には、6M物が▲0.164~▲0.16%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。発行市場は償還・発行総額共に2,000億円程度となった。一部の鉄鋼・その他金融業態において大型案件が見られたものの、その他は小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/12/7	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.079	0.050	0.000	22,498.03	320.99	112.30-32	112.54-56
T/N			0.000				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.080						
2W							-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.120						
1M			0.050				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.150	▲ 0.122						
6M							▲ 0.155	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.162						
									日付	11/30	12/1	12/4	12/5	12/6
									日銀当預残	3,648,200	3,643,100	3,565,100	3,587,300	3,583,100
									準備預金残	3,212,300	3,230,500	3,170,800	3,185,400	3,162,500
									マネタリーベース	4,715,600	4,712,200	4,634,800	4,658,300	4,655,700
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.056%	▲0.052%	▲0.050%	▲0.034%
									コール市場残高	89,180	100,770	94,087	101,101	102,615
									うち無担	65,651	76,312	71,027	77,835	80,187
									うちO/N	37,776	47,767	43,242	49,650	52,412
									うち有担	23,529	24,458	23,060	23,266	22,428

●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	726	-	44,200	2017/12/11	2018/3/19	197,693.0	35,798.5	100.0380	▲0.1414%	33.3869%	100.0409	▲0.1522%	8,401.0
30年利付国債	57	0.80%	8,000	2017/12/20	2047/12/20	28,167.0	6,435.00	98.8000	0.8500%	75.8059%	98.8400	0.8480%	1,555.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2017/12/11	2017/12/25		3,021	3,021				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	84,618	2017/12/7	2017/12/8		366	366		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2017/12/7	2017/12/8		99	99		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月8日の予定

*7-9月期のGDP2次速報
(市場予想：前期比年率+1.5%)
*10月の国際収支
*11月の景気ウォッチャー調査

*米国10月の卸売売上高
*米国11月の雇用統計
*米国12月のミシガン大学、消費者信頼感指数速報

*エネルギー対策借入
(5,500億円、12/20借入)

◆本資料は信頼できるとさ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