

Central Daily Market Report

2017年12月13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13日		2017年12月14日		2017年12月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 2,900		▲ 3,000	
財政	2,600		3,600		42,000	
資金過不足	1,000		700		39,000	
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					9,600	
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 5,900
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F買入	700		200			
国債補完供給	▲ 300	600		300		
当増増減	1,700		1,000		42,700	
当座預金残高	3,608,800		3,609,800		3,652,500	
準備預金残高	3,212,100					
積み終了先	3,211,900				12月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,211,900				積数	
非準備預金先	396,700				1日平均	
					100	
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	99.99%	日数	93.33%		

●2017年12月13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8,000億円減の321兆2,000億円(当座預金残高は360兆9,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀・外銀・証券業態より▲0.040~▲0.025%の出合いと小幅に強含みとなった。一巡後も調整の調達から▲0.035~▲0.025%の出合いと堅調な地合い。ターム物に関しては、翌積み期スタートの月内物で▲0.040%程度の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/14-12/15)は、▲0.045~▲0.03%程度での出合い。S/N(12/15-12/18)は、▲0.075~▲0.065%程度での出合い。S/Nは、新積み期に差し掛かったことで、投資家の資金調達需要が減退したため、レートは低下した。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、動意なく閑散で、3M物、6M物が▲0.185%で出合った程度であった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、五・十日発行に当たり、電気機器、機械、不動産、卸売等の複数業態でまとまった額の発行が散見され、活況なマーケットとなった。償還総額3,000億円弱に対し、発行総額は3,200億円弱とわずかな発行超となった。発行レートについては、特段の変化はなく低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2017/12/13	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.048	0.045	0.005	22,758.07	▲ 108.10	113.53-55	113.43-44
T/N			0.000				-	▲ 0.041						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.230	▲ 0.020				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.038	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.138						
1M							-	▲ 0.132						
3M							▲ 0.175	▲ 0.123						
6M							▲ 0.175	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.159	▲ 0.161						
									日付	12/6	12/7	12/8	12/11	12/12
									日銀当預残	3,583,100	3,587,500	3,595,600	3,585,900	3,607,100
									準備預金残	3,162,500	3,183,400	3,195,200	3,203,000	3,220,900
									マネタリーベース	4,655,700	4,662,800	4,673,000	4,664,600	4,687,600
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.043%	▲0.038%	▲0.036%	▲0.034%
									コール市場残高	102,615	94,260	93,943	90,366	89,538
									うち無担	80,187	70,754	71,334	69,218	68,072
									うちO/N	52,412	42,709	43,724	41,528	40,762
									うち有担	22,428	23,506	22,609	21,148	21,466

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/12/21	2018/6/21	177,890.0	10,500.01		0.0000%	5.9026%		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年超3年以下)	2,500	2017/12/15			8,545	2,505	0.000		0.001	4.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/12/15			10,021	3,006	▲0.006		▲0.005	26.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/12/15			12,947	4,114	0.000		0.001	97.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,633	2017/12/13	2017/12/14		294	294		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/12/13	2017/12/14		7	7		▲0.500	▲0.500	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2017/12/15	2021/12/15	0	28,945

●2017年12月14日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(727回)入札(3ヶ月、44,000億円、12/18発行)	*20年利付国入札(10,000億円、12/20発行)
*英中銀MPC結果発表		
*米国10月の企業在庫		
*米国11月の小売売上高		

◆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