

Central Daily Market Report

2017年12月19日(火)

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19日		2017年12月20日		2017年12月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,200		▲ 3,300		▲ 5,000	
財政	5,800		19,300		▲ 4,000	
資金過不足	2,600		16,000		▲ 9,000	
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	2,500					
国債買入	4,000		9,800			
CP等買入	4,500	▲ 500		▲ 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		▲ 800		
E T F買入	200		700			
国債補完供給	▲ 500	1,000		500		
当預増減	13,700		26,000		▲ 9,000	
当座預金残高	3,686,800		3,712,800		3,703,800	
準備預金残高	3,251,500					
積み終了先	3,235,200		12月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,228,400		積数		39,800	
非準備預金先	435,300		1日平均		1,500	
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額					3,048,200	
準備預金進捗率	実績	98.69%	日数	12.90%		

●2017年12月19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2,000億円減少の324兆9,000億円(当座預金残高見込みは368兆9,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き取り急ぎ動きも見られず、弱含み横ばい圏での推移となった。朝方は地銀業態で▲0.05~▲0.04%、証券・信託・外銀業態で▲0.06~▲0.045%の調達が見られた。一巡後は▲0.065~▲0.040%の出合いが散見された。ターム物は月内のショートタームで▲0.040%近辺の出合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(12/20-12/21)は、▲0.10~▲0.09%程度での出合い。S/N(12/21-12/22)は、▲0.095~▲0.09%程度で出合い。T/N、S/Nともに、業者のファンディングニーズの高まりから、レートは前日より小幅上昇した。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.1925~▲0.19%、1Y物が▲0.165%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは低位で推移した。発行市場は、小売、化学業態などから大型発行が見られ、発行総額は1,300億円程度であった。発行レートは引き続き0%近辺となっている。

●短期金融市場関連指標

2017/12/19	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.094	0.035	0.000	22,868.00	▲ 33.77	112.57-59	112.51-52
T/N	▲ 0.035	0.000	▲ 0.012				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.105						
2W							-	▲ 0.165						
3W							-	▲ 0.148						
1M			0.010				-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.179	▲ 0.130						
6M							▲ 0.168	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.162						
									日付	12/12	12/13	12/14	12/15	12/18
									日銀当預残	3,607,100	3,608,800	3,608,400	3,681,500	3,673,100
									準備預金残	3,220,900	3,212,200	3,196,100	3,249,300	3,239,200
									マネタリーベース	4,687,600	4,690,900	4,693,300	4,768,900	4,761,900
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.032%	▲0.026%	▲0.037%	▲0.046%
									コール市場残高	89,538	92,251	93,160	97,195	105,349
									うち無担	68,072	71,179	72,240	75,339	84,156
									うちO/N	40,762	43,109	43,690	48,279	51,416
									うち有担	21,466	21,072	20,920	21,856	21,193

●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)
流動性供給	251	-	4,000	2017/12/21		11,227.0	3,987.00		▲0.0060%	81.6766%		▲0.0070%	

●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
社債等買入	1,500	2017/12/25			4,204	1,500	0.012		0.030	92.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	54,489	2017/12/19	2017/12/20		503	503		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/12/21	2017/12/29	1.91	101	101				

●2017年12月20日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、21日まで)
- *7-9月期の資金循環統計速報
- *米国11月の中古住宅販売
- *国庫短期証券(729回)入札 (3ヶ月、44,000億円、12/25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