

Central Daily Market Report

2017年12月20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20日		2017年12月21日		2017年12月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,200		▲ 3,800		▲ 5,000	
財政	18,200		▲ 7,300		▲ 1,000	
資金過不足	15,000		▲ 11,100		▲ 6,000	
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	9,800				8,400	
CP等買入	▲ 200		▲ 400			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					100	▲ 100
社債等買入	▲ 800					
E T F 買入	700		100			
国債補完供給	▲ 600		500		600	
当預増減	24,400		▲ 10,800		2,400	
当座預金残高	3,711,200		3,700,400		3,702,800	
準備預金残高	3,278,400					
積み終了先	3,263,400				12月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,262,800				積数	
非準備預金先	432,800				1日平均	
					900	
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	99.20%	日数	16.13%		

●2017年12月20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、前営業日比2兆7,000億円増加の327兆円6,000億円(当座預金残高見込みは371兆3,000億円)。本日の無担O/N物は地銀業態より▲0.050~▲0.040%、証券・外銀・信託業態より▲0.060~▲0.045%での調達で始まった。一巡後は▲0.065~▲0.045%程度で散発的な出会いが見られる中、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、年内エンドのショートタームで▲0.045~▲0.040%での出会いが見られていた。

<レポ市場>

GC T/N(12/21-12/22)は、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。S/N(12/22-12/25)は、▲0.095~▲0.09%程度での出会い。キャッシュ潰しのビッドニーズが強く、T/N、S/Nともに政策金利の▲0.10%近辺で底堅く推移した。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、3M(729回)の入札が実施された。今回の入札は、償還日が年度末越えとなるため強めの結果となることも予想されていた。WI取引において▲0.19%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1881%、按分落札利回▲0.1751%と按分レートが流れる結果となった。セカンダリーでは、▲0.185~▲0.18%出会いと底堅く推移した。この他に、6M物が▲0.15%、1Y物が▲0.154~▲0.146%での出会いが見られた。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、機械、建設、不動産業態などから大型発行が見られ、発行総額は3,300億円程度まで膨らんだ。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

2017/12/20	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.092	0.050	0.015	22,891.72	23.72	113.00-01	113.13-14
T/N			0.000				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.003	▲ 0.032				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.156						
3W							-	▲ 0.140						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.180	▲ 0.128						
6M							▲ 0.160	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.157	▲ 0.162						
									日付	12/13	12/14	12/15	12/18	12/19
									日銀当預残	3,608,800	3,608,400	3,681,500	3,673,100	3,686,800
									準備預金残	3,212,200	3,196,100	3,249,300	3,239,200	3,251,800
									マネタリーベース	4,690,900	4,693,300	4,768,900	4,761,900	4,778,900
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.026%	▲0.037%	▲0.046%	▲0.048%
									コール市場残高	92,251	93,160	97,195	105,349	107,413
									うち無担	71,179	72,240	75,339	84,156	85,305
									うちO/N	43,109	43,690	48,279	51,416	50,625
									うち有担	21,072	20,920	21,856	21,193	22,108

●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	729	-	43,600	2017/12/25	2018/4/5	135,724.0	35,452.70	100.0485	▲0.1751%	42.9500%	100.0521	▲0.1881%	8,147.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2017/12/22			9,422	2,505	0.006		0.007	72.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/12/22			9,684	3,004	0.008		0.008	62.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/12/22			5,093	2,005	0.007		0.009	19.7
国債買入(残存期間25年超)	900	2017/12/22			2,923	904	0.013		0.014	37.1
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	63,532	2017/12/20	2017/12/21		610	610		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月21日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*黒田日銀総裁定例会見 *月例経済報告	*米国7-9月期のGDP確報値
-----------------------------------	------------------------	-----------------

◆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