

Central Daily Market Report

2017年12月22日(金)

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22日		2017年12月25日		2017年12月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,700		▲ 2,300		▲ 3,000	
財政	▲ 300		▲ 9,000		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 4,000		▲ 11,300		▲ 7,000	
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			5,200	▲ 3,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入					10,000	
国債買入	8,600					
CP等買入		▲ 1,000		▲ 1,100		
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		▲ 100	1,500	▲ 100		
E T F買入	700		300			
国債補完供給	▲ 400	2,800		400		
当預増減	6,600		▲ 8,200		3,000	
当座預金残高	3,704,100		3,695,900		3,698,900	
準備預金残高	3,280,900					
積み終了先	3,279,600				12月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,277,900				積数 6,300	
非準備預金先	423,200				1日平均 300	
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	99.79%	日数	29.03%		

●2017年12月22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15,000億円増加の328兆5,000億円(当座預金残高見込みは370兆6,000億円)。本日の無担O/Nは週末を挟む取引となり、前日対比で調達姿勢がやや強含む地合いとなった。朝方は地銀・証券業態で▲0.045~▲0.04%、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~▲0.04%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▲0.04%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/25-12/26)は、▲0.09~▲0.08%程度での出合い。S/N(12/26-12/27)は、▲0.095~▲0.085%程度で出合い。キャッシュ潰しのビッドニーズがやや減退し、T/N、S/Nともにレートは小幅上昇した。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、短国買入オペが予想上限の10,000億円(前日比+7,500億円)でオフアされた。業者の在庫が膨らんでいることや年末を控えた調整売りからか、平均落札利回較差+0.004%、按分落札利回較差+0.003%と小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.209~▲0.20%、1Y物が▲0.16%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は機械、建設、ノンバンク業態などから大型発行が見られ、1,300億円程度の償還に対して、発行総額は2,400億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

2017/12/22	無担(速報)			有担(速報)			短国 ※買付者統計値	東京 レポレート 平均値	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	▲ 0.044				-	▲ 0.091	0.045	▲ 0.010	22,902.76	36.66	113.31-32	113.40-41
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.043				-	▲ 0.167						
2W							-	▲ 0.145						
3W							-	▲ 0.134						
1M			0.020				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.197	▲ 0.128						
6M							▲ 0.160	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.161						
									日付	12/15	12/18	12/19	12/20	12/21
									日銀当預残	3,681,500	3,673,100	3,686,800	3,711,200	3,697,500
									準備預金残	3,249,300	3,239,200	3,251,800	3,278,900	3,271,900
									マネタリーベース	4,768,900	4,761,900	4,778,900	4,806,500	4,796,800
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.046%
									コール市場残高	97,195	105,349	107,413	109,844	110,359
									うち無担	75,339	84,156	85,305	87,127	86,004
									うちO/N	48,279	51,416	50,625	52,097	50,699
									うち有担	21,856	21,193	22,108	22,717	24,355

●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	252	-	5,500	2017/12/26		17,225.0	5,495.00		▲0.0150%	75.6714%		▲0.0170%	

●オペ結果

種類	オフア額(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
国庫短期証券買入	10,000	2017/12/26			23,032	10,001	0.003		0.004	96.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)	89,168	2017/12/22	2017/12/25		352	352		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月25日の予定

*クリスマス *New York、EURO、London祝日(Christmas Day)
*10月の景気動向指数改訂状況

◆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