

Central Daily Market Report

2017年12月29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29日		2018年1月4日		2018年1月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		5,900		6,000	
財政	▲ 7,000		▲ 1,500		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 7,700		4,400		3,000	
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	▲ 4,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,300		7,100			
CP等買入	5,500	▲ 4,100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3,900	700		3,900		
当預増減	▲ 3,200		14,200		3,000	
当座預金残高	3,686,100		3,700,300		3,703,300	
準備預金残高	3,230,300					
積み終了先	3,230,100		1月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,230,100		積数		2,000	
非準備預金先	455,800		1日平均		200	
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額					3,051,300	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	61.29%		

●2017年12月29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1,000億円減少の326兆円(当座預金残高見込みは369兆3,000億円)。本日の無担O/Nは年末越えとなるため、調達を控える先も多く、レートは大幅に低下した。朝方は地銀業態で▲0.05~▲0.04%、信託・証券業態で▲0.07%台の調達が見られた。一巡後は調達サイドが薄く▲0.07%台で散発的な出合いが見られた程度となった。ターム物は1月スタートのショートタームで▲0.04%近辺の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/4-1/5)は、▲0.080~▲0.075%程度での出合い。S/N(1/5-1/9)は、▲0.080~▲0.065%程度で出合い。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、2Y381~383、5Y130~134、10Y336~349、30Y51~57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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。CP発行市場は、年末休暇に入った事業法人も多く、案件は少なかった。石油業態からややまとまった発行が見られ、発行総額は750億円程度となった。発行レートは横ばい圏での決着であった。

●短期金融市場関連指標

2017/12/29	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.098	0.045	▲ 0.005	22,764.94	▲ 19.04	112.88-89	112.64-66
T/N			0.000				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.025				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.093						
1M	▲ 0.020	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.100						
3M			▲ 0.005				▲ 0.162	▲ 0.124						
6M							▲ 0.154	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.161						
									日付	12/22	12/25	12/26	12/27	12/28
									日銀当預残	3,704,100	3,695,400	3,696,800	3,696,000	3,689,300
									準備預金残	3,281,000	3,265,600	3,270,100	3,271,000	3,260,300
									マネタリーベース	4,807,100	4,800,800	4,805,000	4,807,200	4,803,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.045%	▲ 0.043%	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.036%
									コール市場残高	113,008	106,875	108,207	112,455	102,155
									うち無担	89,874	83,941	85,337	89,702	79,222
									うちO/N	52,939	47,586	49,252	54,057	44,332
									うち有担	23,134	22,934	22,870	22,753	22,933

●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	70,000	2017/12/29	2018/1/4		3,829	3,829		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月3日の予定

*米国11月の建設支出
*米国12月のISM製造業景況指数

●2018年1月4日の予定

*証券取引所大発会

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願ひ申し上げます。

◆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