

# Central Daily Market Report

2018年12月6日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2018年12月6日		2018年12月7日		2018年12月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 1,900		▲ 1,000	
財政	3,300		700		▲ 17,000	
資金過不足	1,100		▲ 1,200		▲ 18,000	
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						▲ 2,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,600					
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 400		
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	▲ 1,200	900		1,200		
当預増減	8,300		1,600		▲ 20,600	
当座預金残高	3,785,000		3,786,600		3,766,000	
準備預金残高	3,328,200					
積み終了先	3,328,000					12月7日以降の残り所要積立額
超過準備	3,328,000					積数 1,500
非準備預金先	456,800					1日平均 200
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額						3,008,500
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	70.00%		

## ●2018年12月6日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.086~▲0.04%の調達で始まった。昨日と同様、調達サイドの参加者数は回復傾向にあるものの、レートを切り上げてまで調達を行う動きは無く、出会い水準は昨日とほぼ同様となった。ターム物は、1~2W物のショートタームで▲0.04~▲0.03%のレンジで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T+0(12/6-12/7)は▲0.09~▲0.08%程度、T/N(12/7-12/10)は▲0.10~▲0.085%程度で出会いが見られた。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10Y341~352や、5Y133、20Y166などにビッドが目立った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.17~▲0.165%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1683%、按分落札利回▲0.1603%と前回債からレートが上昇する結果となった。セカンダリーでは、▲0.1775~▲0.1725%での出会いと強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.167~▲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、電気・ガス、石油・石炭等の業態でまとまった調達が行われ、発行総額は2,000億円弱と償還総額の1,700億円程度を上回り、連日の発行超となった。発行レートは、直近の市場残高の拡大を受け、深いマイナスでの買いは一巡した一方、0%近辺での買いニーズは強く、多くの銘柄は引き続き0%近辺の狭いレンジで決着している。

## ●短期金融市場関連指標

2018/12/6	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.089	0.050	▲ 0.015	21,501.62	▲ 417.71	113.04-05	113.08-10
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.120						
3W							-	▲ 0.131						
1M							-	▲ 0.171						
3M							▲ 0.235	▲ 0.160						
6M							▲ 0.175	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.159						
									日付	11/29	11/30	12/3	12/4	12/5
									日銀当預残	3,909,700	3,912,900	3,877,400	3,804,600	3,776,700
									準備預金残	3,418,300	3,424,400	3,410,700	3,329,800	3,310,100
									マネタリーベース	5,013,000	5,016,700	4,981,800	4,910,100	4,883,700
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.062%	▲0.069%	▲0.069%	▲0.069%
									コール市場残高	101,360	88,984	94,760	99,542	111,872
									うち無担	81,763	69,361	66,414	72,531	76,574
									うちO/N	49,033	38,691	37,124	42,961	46,904
									うち有担	19,597	19,623	28,346	27,011	35,298

## ●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	800	-	23,000	2018/12/10	2019/6/10	93,580.0	18,947.7	100.0800	▲0.1603%	78.0465%	100.0840	▲0.1683%	4,052.0
流動性供給	275	-	5,000	2018/12/7		10,442.0	4,998.0		0.0000%	40.4643%		▲0.0050%	

## ●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)	190,132	2018/12/6	2018/12/7		1,189	1,189		▲0.600	▲0.600	

## ●2018年12月7日の予定

- \*10月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+1.4%)
- \*10月の景気動向指数速報
- \*10月の毎月勤労統計調査速報
- \*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*米国10月の卸売売上高
- \*米国10月の消費者信用残高
- \*米国11月の雇用統計
- \*米国12月のミンガン大消費者信頼感指数速報
- \*ユーロ圏7-9月期のGDP確報値
- \*国庫短期証券(801回)入札 (3ヶ月、42,700億円、12/10発行)
- \*エネルギー対策借入 (5,500億円、12/20借入)

◆本資料は信頼できるとさ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