

Central Daily Market Report

2018年12月12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	2018年12月12日		2018年12月13日		2018年12月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 3,100		▲ 3,000	
財政	▲ 7,800		4,800		56,000	
資金過不足	▲ 9,800		1,700		53,000	
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	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 400	2,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					17,400	▲ 31,300
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 600	3,600		600		
当預増減	▲ 6,400		2,600		41,100	
当座預金残高	3,771,700		3,774,300		3,815,400	
準備預金残高	3,359,900					
積み終了先	3,359,700		12月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,359,700		積数		600	
非準備預金先	411,800		1日平均		200	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,011,600	
準備預金進捗率	実績		99.98%		日数	
					90.00%	

●2018年12月12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~▲0.03%の調達で始まった。積み最終日を目前に控え、複数の先から積極的な調達ニーズが見られたことから、ややレートが上昇し、出合いの中心は▲0.085~▲0.03%となった。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T+0(12/12-12/13)は▲0.085~▲0.08%程度、T/N(12/13-12/14)は▲0.09~▲0.08%程度で出合いが見られた。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10Y335~352や、5Y133~137、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.185%、1Y物が▲0.168%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、前倒しの5・10日発行にあたり、機械・ゴム製品・不動産・その他金融業態で大型の案件が実施され、発行総額は4,900億円程度まで膨らんだ。発行レートは、引き続き0%近辺で推移した。

●短期金融市場関連指標

2018/12/12	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	▲ 0.066				-	▲ 0.084	0.050	0.010	21,602.75	454.73	113.38-39	113.40-41
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.144						
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.028				-	▲ 0.161						
3W							-	▲ 0.290						
1M							-	▲ 0.273						
3M							▲ 0.240	▲ 0.173						
6M							▲ 0.185	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.163						
									日付	12/5	12/6	12/7	12/10	12/11
									日銀当預残	3,776,700	3,785,000	3,786,300	3,767,800	3,778,100
									準備預金残	3,310,100	3,328,200	3,352,000	3,311,600	3,348,300
									マネタリーベース	4,883,700	4,894,200	4,897,300	4,879,700	4,891,400
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.070%	▲0.067%	▲0.068%	▲0.068%
									コール市場残高	111,872	115,399	104,462	114,667	121,554
									うち無担	76,574	82,221	78,525	84,804	91,167
									うちO/N	46,904	52,096	47,090	52,689	58,952
									うち有担	35,298	33,178	25,937	29,863	30,387

●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	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)	77,358	2018/12/12	2018/12/13		571	571		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,053	2018/12/12	2018/12/13		33	33		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2018/12/14	2022/12/14	0	17,417					

●2018年12月13日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	*5年利付国債入札(20,000億円、12/14発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、12/21借入)
-------------------	-----------------------------	------------------------------

◆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