Central Daily Market Report

2018年12月17日(月)

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17日		2018年12月18日		2018年12月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 2,700		▲ 4,000	
財政	10,400		2,400		▲ 12,000	
資金過不足	8,700		▲ 300		▲ 16,000	
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	1,900	▲ 1,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,000		8,600			
CP等買入		▲ 400		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 300		
E T F 買入	1,700					
国債補完供給	▲ 1,200	700		1,200		
当預増減	16,500		9,000		▲ 16,000	
当座預金残高	3,833,100		3,842,100		3,826,100	
準備預金残高	3,333,500					
積み終了先	3,237,100					
超過準備	2,825,500					
非準備預金先	499,600					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,124,000	
準備預金進捗率	実績	96.08%	日数	6.45%		

●2018年12月17日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.086～▲0.035%の調達で始まった。新しい積み期間に入り、年金定時払いや、マクロ加算残高にかかる基準比率の低下による警戒感からか、先週末同様に調達意欲は乏しく、出し残りが散見された。ターム物は月内物の出合いが複数見られた。

＜レポ市場＞

GC T+0(12/17-12/18)は▲0.25～▲0.20%程度、T/N(12/18-12/19)は▲0.23～▲0.17%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、5Y130～137、20Y164～166、30Y57～60などカレント近辺の銘柄にビッドが目立った。

＜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、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.255～▲0.253%、6M物が▲0.225%、1Y物が▲0.20～▲0.195%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは低位横ばい圏で推移した。発行市場は、卸売、石油業態から大型案件が見られ発行総額は1,500億円程度であった(償還総額1,000億円程度)。発行レートは0%近辺が中心であった。

●短期金融市場関連指標

2018/12/17	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.200	0.030	0.000	21,506.88	132.05	113.39-41	113.40-41
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.226						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.053	0.230	▲ 0.045				-	▲ 0.227						
2W							-	▲ 0.365						
3W							-	▲ 0.339						
1M							-	▲ 0.316						
3M							▲ 0.255	▲ 0.178						
6M							▲ 0.205	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.185	▲ 0.164						
									日付	12/10	12/11	12/12	12/13	12/14
									日銀当預残	3,767,800	3,778,100	3,771,700	3,773,300	3,816,600
									準備預金残	3,311,600	3,348,300	3,359,900	3,382,300	3,327,200
									マネタリーベース	4,879,700	4,891,400	4,887,100	4,891,800	4,937,800
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.062%	▲0.065%
									コール市場残高	114,667	121,554	120,720	115,869	97,806
									うち無担	84,804	91,167	90,291	85,894	74,800
									うちO/N	52,689	58,952	58,476	54,209	45,535
									うち有担	29,863	30,387	30,429	29,975	23,006

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/12/18			7,905	3,502	▲0.001		0.001	47.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/12/18			11,032	4,004	▲0.007		▲0.006	91.1
国債買入(変動利付債)	1,000	2018/12/18			2,168	1,000	▲0.140		▲0.189	21.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	141,117	2018/12/17	2018/12/18		1,136	1,136		▲0.600	▲0.600	

●2018年12月18日の予定

*米国FOMC(1日目)	*20年利付国債入札
*米国11月の住宅着工件数	(10,000億円、12/19発行)

◆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