

Central Daily Market Report

2016年12月1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	2016年12月1日		2016年12月2日		2016年12月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,800		▲ 1,700		▲ 1,000	
財政	▲ 9,100		▲ 72,400		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 10,900		▲ 74,100		▲ 8,000	
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					1,500	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			11,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)			6,200	▲ 5,200		▲ 100
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入						
国債補充供給		100				
当預増減	▲ 11,000		▲ 61,700		▲ 8,100	
当座預金残高	3,166,000		3,104,300		3,096,200	
準備預金残高	2,843,600					
積み終了先	2,399,300		12月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,399,300		積数		6,600	
非準備預金先	322,400		1日平均		500	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					2,110,900	
準備預金進捗率	実績	99.69%	日数	53.33%		

●2016年12月1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5,000億円減の239兆6,000億円(当座預金残高見込みは、316兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀、証券業態による▲0.08~▲0.035%のレンジでの出会いとなった。月末の剥落要因があったものの、大きなレート変動もなく、落ち着いた展開となった。一巡後は調整の調達もほとんど見られず、取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03~▲0.01%の出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/2-12/5)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(12/5-12/6)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では2Y367~370、5Y127~129、10Y335~344、30Y49~30Y52などカレント近辺の銘柄にビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は、3M物の入札が実施された。海外勢のニーズからか、WI取引で▲0.345~▲0.34%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.3408%・按分落札利回▲0.3330%と好調な結果となった。セカンダリーでは、3M物で一時▲0.3925%の出合いも見られた。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額800億円弱に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超となった。5・10日発行となったことに加え、配当金・賞与等の資金調達ニーズからか、発行件数も増加し、マーケットはやや活況であった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/1	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.102	0.030	0.015	18,513.12	204.64	114.69-70	114.16-17
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.025				-	▲ 0.106						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.107						
3W			0.001				-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.378	▲ 0.147						
6M							▲ 0.297	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	11/24	11/25	11/28	11/29	11/30
									日銀当預残	3,147,000	3,144,800	3,149,000	3,155,900	3,177,000
									準備預金残	2,833,500	2,823,000	2,833,700	2,829,900	2,838,800
									マネタリーベース	4,164,800	4,163,300	4,168,000	4,176,200	4,198,400
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.052%	▲0.054%
									コール市場残高	83,999	86,572	82,062	89,229	75,346
									うち無担	64,926	67,139	62,602	69,732	55,428
									うち有担	19,073	19,433	19,460	19,497	19,918

●入札結果

名称	回数	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	649	-	44,000	2016/12/5	2017/3/13	185,348.0	39,820.0	100.0895	▲0.3330%	8.5000%	100.0916	▲0.3408%	4,180.0
10年利付国債	345	0.10%	24,000	2016/12/20	2026/12/20	83,001.0	21,981.00	100.5900	0.0400%	40.6682%	100.6700	0.0320%	1,982.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2016/12/5	2016/12/19		1,510	1,510				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,432	2016/12/1	2016/12/2		18	18		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,068	2016/12/1	2016/12/2		6	6		▲0.600	▲0.600	

●2016年12月2日の予定

*11月のマネタリーベース

*11月実績/12月見込み財政資金対民間収支

*米国11月の雇用統計

◆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。

◆本資料は何ら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