Central Daily Market Report

2016年12月2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	2016年12月2日 需給速報		2016年12月5日 需給予想		2016年12月6日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 72,700		▲ 3,800		2,000	
資金過不足	▲ 74,300		▲ 4,200		1,000	
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					5,000	
国債買入	11,800				12,300	
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)	6,200	▲ 5,200				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 61,900		▲ 4,500		18,300	

当座預金残高	3,104,100	3,099,600	3,117,900
準備預金残高	2,789,600		
積み終了先	2,350,100		
超過準備	2,350,100		
非準備預金先	314,500		

12月5日以降の残り所要積立額	
積数	4,200
1日平均	400

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	99.80%	日数	63.33%

●2016年12月2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4兆3,000億円減の235兆3,000億円(当座預金残高見込みは、310兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.035%の寄付き後、邦銀、証券業態による▲0.08～▲0.03%の出合いとなった。税揚げによる不足日となったことで、地銀業態を中心にしっかりとした調達ニーズが見られた。後場は閑散。ターム物に関しては特段目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(12/5-12/6)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(12/6-12/7)は、▲0.10～▲0.095%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>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。売り物が少なく強含んだ相場の中、短国買入オペが前回比で5,000億円の減額となる5,000億円でオファーされた。平均落札利回較差▲0.030%、按分落札利回較差▲0.059%と、品薄感を反映した底堅い結果となった。オペ後の出合いは、3M物で▲0.388%が少額散見された程度であった。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額1,200億円弱に対して、発行総額は500億円弱と償還超となった。配当金・賞与等の資金調達ニーズが一服したためか、発行件数も少なく落ち着いたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/2	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.049				－	▲ 0.098
T/N							－	▲ 0.093
S/N							－	－
1W			▲ 0.005				－	▲ 0.106
2W			▲ 0.010				－	▲ 0.107
3W							－	▲ 0.112
1M							－	▲ 0.152
3M							▲ 0.392	▲ 0.148
6M							▲ 0.304	▲ 0.225
1Y							▲ 0.307	▲ 0.228

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.035	0.005	18,426.08	▲ 87.04	113.88-92	113.93-96

日付		11/25	11/28	11/29	11/30	12/1
日銀当預残		3,144,800	3,149,000	3,155,900	3,177,000	3,166,000
準備預金残		2,823,000	2,833,700	2,829,900	2,838,800	2,843,900
マネタリーベース		4,163,300	4,168,000	4,176,200	4,198,400	4,189,200
無担O/N加重平均		▲0.054%	▲0.054%	▲0.052%	▲0.054%	▲0.051%
コール市場残高		86,572	82,062	89,229	75,346	85,462
	うち無担	67,139	62,602	69,732	55,428	65,330
	うち有担	19,433	19,460	19,497	19,918	20,132

●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Ⅰ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
国庫短期証券買入	5,000	2016/12/6			8,774	5,000	▲0.059		▲0.030	54.4
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2016/12/6			8,980	4,005	▲0.009		▲0.003	52.0
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2016/12/6			6,140	4,202	0.001		0.005	9.7
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2016/12/6			6,831	4,101	0.005		0.008	1.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	34,898	2016/12/2	2016/12/5		14	14		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2016/12/2	2016/12/5		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2016年12月5日の予定

*黒田日銀総裁、
　パリ・ユーロプラス・フィナンシャル・フォーラムにて講演
*11月の消費動向調査
*12月の日銀当座預金増減要因見込み
*米国11月のFRB労働市場情勢指数
*米国11月のISM非製造業景況指数

◆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論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