

Central Daily Market Report

2016年12月5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	2016年12月5日		2016年12月6日		2016年12月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,300		▲ 1,000	
財政	▲ 3,800		1,200		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 4,300		▲ 100		▲ 3,000	
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			12,500		3,700	
CP等買入		▲ 300		▲ 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	▲ 1,100			1,100		
当預増減	▲ 5,700		18,100		700	
当座預金残高	3,098,400		3,116,500		3,117,200	
準備預金残高	2,768,100					
積み終了先	2,328,100		12月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,328,100		積数		3,500	
非準備預金先	330,300		1日平均		300	
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	99.83%	日数	66.67%		

●2016年12月5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4,000億円減の23兆9,000億円(当座預金残高見込みは310兆円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態による▲0.08~▲0.03%の出合いとほぼ前週末横ばいとなった。一巡後は▲0.085~▲0.07%で調整程度の出合いが見られた。後場は▲0.04%が出合っして本日の取引を終えた。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(12/6-12/7)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(12/7-12/8)は、▲0.095~▲0.09%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2Y368~370、5Y127~129、10Y336~344、30Y50~30Y52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物は引き続き低位で推移した。短国市場は閑散な地合いが続いており、売り物も薄い中、6Mが▲0.35%で少額出合った程度だった。

<CP市場>

CP市場は、ノンバンクや卸売業態等でまとまった額の調達が行われ、償還増額100億円弱に対し、発行総額は1,200億円弱まで膨らんだ。発行レートについては、ロットの大きい物や月内物でわずかに上昇する動きも見られたが、全体としては0%近辺の狭いレンジで推移していた。

●短期金融市場関連指標

2016/12/5	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.098	0.025	▲ 0.010	18,274.99	▲ 151.09	113.51-54	113.90-92
T/N							-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.112						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.397	▲ 0.148						
6M							▲ 0.305	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228						
									日付	11/28	11/29	11/30	12/1	12/2
									日銀当預残	3,149,000	3,155,900	3,177,000	3,166,000	3,104,100
									準備預金残	2,833,700	2,829,900	2,838,800	2,843,900	2,790,200
									マネタリーベース	4,168,000	4,176,200	4,198,400	4,189,200	4,129,000
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.052%	▲0.054%	▲0.051%	▲0.049%
									コール市場残高	82,062	89,229	75,346	85,462	86,438
									うち無担	62,602	69,732	55,428	65,330	65,705
									うち有担	19,460	19,497	19,918	20,132	20,733

●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	棄分率	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年以下)	700	2016/12/7			2,968	706	▲0.004		0.027	10.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/12/7			6,667	1,902	▲0.004		▲0.003	95.2
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/12/7			3,566	1,106	▲0.019		▲0.017	54.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	66,122	2016/12/5	2016/12/6		734	734		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,226	2016/12/5	2016/12/6		285	285		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月6日の予定

*10月の毎月勤労統計調査速報	*米国10月の貿易収支 *米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫 *ユーロ圏7-9月期のユーロ圏GDP確報値	*流動性供給入札 (4,000億円、12/8発行)
-----------------	--	------------------------------

◆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