

Central Daily Market Report

2016年12月6日(火)
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6日		2016年12月7日		2016年12月8日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 1,400	▲ 1,300	▲ 1,300	▲ 1,300	▲ 2,000	▲ 2,000
財政	1,000	3,600	3,600	3,600	▲ 1,000	▲ 1,000
資金過不足	▲ 400	2,300	2,300	2,300	▲ 3,000	▲ 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						
国債買現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	12,500		4,100			
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
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	▲ 500	1,100		500		
当預増減	17,300		6,800		▲ 3,000	
当座預金残高	3,115,700		3,122,500		3,119,500	
準備預金残高	2,806,400					
積み終了先	2,367,700		12月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,367,700		積数		3,000	
非準備預金先	309,300		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	99.86%	日数		70.00%	

●2016年12月6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1兆7,000億円増の236兆6,000億円(当座預金残高見込みは311兆7,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態による▲0.085~▲0.03%の出合いとなった。一巡後は動意に乏しく閑散。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03~▲0.015%の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/7-12/8)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(12/8-12/9)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。特段の出合いも無く、閑散な地合いが続いている。

<CP市場>

CP市場は前日に引き続き、卸売業態等でまとまった額の調達が行われ、償還総額650億円程度に対し、発行総額1,200億円程度となった。発行レートは、一部銘柄を除き、大部分が0%近辺で決着した。本日は、CP等買入オペが前日比1,000億円増額となる4,500億円を実施された。11月末に発行量が膨らんだこともあり、応札額は1兆366億円と、前月中(5,000億~6,000億円台)から増加する形となったが、平均落札利回▲0.002%、按分落札利回▲0.004%と、按分は前日比横ばい、平均は若干低下の結果となった。年末にかけてのオペ金利低下期待もあり、高い水準で売り急ぐ動きは限定的だったことが要因と考えられる。

●短期金融市場関連指標

2016/12/6	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.098	0.045	0.020	18,360.54	85.55	113.85-89	113.83-84
T/N							-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	0.001	0.010	0.003				-	▲ 0.101						
2W			▲ 0.033				-	▲ 0.103						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.148						
3M							▲ 0.397	▲ 0.148						
6M							▲ 0.305	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228						
									日付	11/29	11/30	12/1	12/2	12/5
									日銀当預残	3,155,900	3,177,000	3,166,000	3,104,100	3,098,400
									準備預金残	2,829,900	2,838,800	2,843,900	2,790,200	2,768,100
									マネタリーベース	4,176,200	4,198,400	4,189,200	4,129,000	4,123,800
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.054%	▲0.051%	▲0.049%	▲0.052%
									コール市場残高	89,229	75,346	85,462	86,438	85,769
									うち無担	69,732	55,428	65,330	65,705	64,184
									うち有担	19,497	19,918	20,132	20,733	21,585

●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・利回較差	素分率	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)
流動性供給	227	-	4,000	2016/12/8		7,321.0	3,997.00		0.0350%	73.7500%		0.0180%	

●オペ結果

種類	オフター額(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
CP等買入	4,500	2016/12/9			10,366	4,497	▲0.004		▲0.002	23.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)	41,337	2016/12/6	2016/12/7		120	120		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)	29,983	2016/12/6	2016/12/7		377	377		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/12/8	2016/12/15	0.89	11	11				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2016/12/7	2016/12/16		13	13		▲0.100	▲0.100	

●2016年12月7日の予定

*岩田日銀副総裁、長崎県金融懇話会にて講演	*米国10月の消費者信用残高	*国庫短期証券(650回)入札(6ヶ月、35,000億円、12/12発行)
*10月の景気動向指数速報		*交付税特別会計借入(10,500億円、12/16借入)
*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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