

Central Daily Market Report

2016年12月8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8日		2016年12月9日		2016年12月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,400		▲ 2,200		▲ 1,000	
財政	▲ 2,600		▲ 2,900		▲ 22,000	
資金過不足	▲ 5,000		▲ 5,100		▲ 23,000	
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					2,000	▲ 2,900
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 200	4,500	▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入			700			
国債補充供給	▲ 300			300		
当預増減	▲ 5,500		12,500		▲ 23,900	
当座預金残高	3,113,800		3,126,300		3,102,400	
準備預金残高	2,801,600					
積み終了先	2,366,500			12月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,366,500			積数	2,000	
非準備預金先	312,200			1日平均	300	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額						
					2,122,300	
準備預金進捗率						
	実績	99.91%		日数	76.67%	

●2016年12月8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4,000億円増の236兆9,000億円(当座預金残高見込みは311兆6,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態による▲0.086~0%の出会いとなった。ターム物に関してはショートタームで▲0.03%の出会いが散見された。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物が8,000億円オファーされ、結果は1,950億円(期落ち分2,851億円)の落札で未達となった。

<レポ市場>

GC T/N(12/9-12/12)は、▲0.09~▲0.085%程度の出会い。S/N(12/12-12/13)は、▲0.09~▲0.085%程度の出会い。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。本日は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.40~▲0.39%が出合う中、平均落札利回▲0.4032%、按分落札利回▲0.3903%と、海外需要からか、過去最低を更新するかなり強めの結果となった。その後は、3M▲0.445~▲0.42%、6M▲0.385~▲0.36%での出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、機械、建設、石油業態でまとまった額の調達が行われたこともあり、償還総額1,400億円程度に対し、発行総額は2,000億円弱となった。発行レートは、全体的に横ばい圏でありながらも、期越物では低下余地を探る展開となった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/8	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.098	0.040	0.010	18,765.47	268.78	113.72-75	113.64-66	
T/N							-	▲ 0.092							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.099							
2W			▲ 0.031				-	▲ 0.102							
3W							-	▲ 0.146							
1M							-	▲ 0.149							
3M							▲ 0.438	▲ 0.150							
6M							▲ 0.379	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228							
									日付		12/1	12/2	12/5	12/6	12/7
									日銀当預残		3,166,000	3,104,100	3,098,400	3,115,700	3,119,300
									準備預金残		2,843,900	2,790,200	2,768,100	2,806,400	2,799,800
									マネタリーベース		4,189,200	4,129,000	4,123,800	4,142,500	4,147,300
									無担O/N加重平均		▲0.051%	▲0.049%	▲0.052%	▲0.054%	▲0.056%
									コール市場残高		85,462	86,438	85,769	84,815	84,688
									うち無担		65,330	65,705	64,184	63,730	63,029
									うち有担		20,132	20,733	21,585	21,085	21,659

●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	651	-	44,100	2016/12/12	2017/3/21	162,062.0	39,908.7	100.1060	▲0.3903%	15.2061%	100.1095	▲0.4032%	4,191.0
30年利付国債	53	0.60%	8,000	2016/12/20	2046/12/20	20,646.0	7,239.00	99.1500	0.6330%	51.1013%	99.5500	0.6170%	757.0

●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	2016/12/12	2016/12/26		1,950	1,950				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	82,378	2016/12/8	2016/12/9		264	264		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	7,077	2016/12/8	2016/12/9		30	30		▲0.600	▲0.600	

●2016年12月9日の予定

*10月の特定サービス産業動態統計速報	*米国10月の卸売売上高	*エネルギー対策借入(6,000億円、12/20借入)
*10-12月期の法人企業景気予測調査季報	*米国12月のミンガン大学消費者信頼感指数速報	
*11月のマネーストック		

◆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