

# Central Daily Market Report

2016年12月12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12日 需給速報	2016年12月13日 需給予想	2016年12月14日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 2,500	▲ 2,000			
財政	▲ 29,000	1,500	26,000			
資金過不足	▲ 29,900	▲ 1,000	24,000			
<b>金融調節</b>						
	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			12,500			
国債買入			11,300			
CP等買入		▲ 400	▲ 900			
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	300		100			
国債補完供給	▲ 200	100	200			
当預増減	▲ 31,000		22,200			24,000
当座預金残高	3,094,500		3,116,700			3,140,700
準備預金残高	2,795,100					
積み終了先	2,355,900				12月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,355,600				積数	200
非準備預金先	299,400				1日平均	100
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	99.99%	日数	90.00%		

## ●2016年12月12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2兆円減の235兆6,000億円(当座預金残高見込みは309兆6,000億円)。本日の無担O/Nは邦銀、証券業態による▲0.083~▲0.01%の出合いとなった。一巡後は▲0.080~▲0.035%で出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.030~▲0.001%の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(12/13-12/14)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(12/14-12/15)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。T/Nは、短国買入オペ等の要因があったものの、売り手の資金調達意欲が強く、出合いを伴いながらレートは上昇した。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、20Y156~158、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は低位横ばい圏で推移。アウトライク市場は全般的に動意無く閑散の中、6M物で▲0.34%の出合いが見られた程度であった。

### <CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は、100億円程度の償還に対して、500億円程度の発行が見られた。石油業態から大型の発行が実施されたものの、総じて案件に乏しく閑散であった。発行レート水準に目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/12/12	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	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.083	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.097	0.070	0.020	19,155.03	158.66	115.41-43	115.82-84		
T/N			0.000				-	▲ 0.092								
S/N							-	-								
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.100								
2W							-	▲ 0.104								
3W							-	▲ 0.161								
1M							-	▲ 0.152								
3M							▲ 0.443	▲ 0.149								
6M							▲ 0.364	▲ 0.225								
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228								
											日付	12/5	12/6	12/7	12/8	12/9
											日銀当預残	3,098,400	3,115,700	3,119,300	3,113,800	3,125,500
											準備預金残	2,768,100	2,806,400	2,799,800	2,801,700	2,810,800
											マネタリーベース	4,123,800	4,142,500	4,147,300	4,144,200	4,158,100
											無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.054%	▲0.056%	▲0.053%	▲0.050%
											コール市場残高	85,769	84,815	84,688	82,456	89,851
											うち無担	64,184	63,730	63,029	60,547	67,666
											うち有担	21,585	21,085	21,659	21,909	22,185

## ●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)	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	52,779	2016/12/12	2016/12/13		193	193		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年12月13日の予定

*10月のマネタリーサーベイ	*米国FOMC(1日目) *英国11月の消費者物価指数	*5年利付国債入札 (24,000億円、12/20発行)
----------------	--------------------------------	---------------------------------

◆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