

Central Daily Market Report

2016年12月13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13日		2016年12月14日		2016年12月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,500		▲ 2,000		▲ 3,000	
財政	1,000		27,000		57,000	
資金過不足	▲ 1,500		25,000		54,000	
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	12,500					
国債買入	11,300					
CP等買入		▲ 900		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					59,800	▲ 9,600
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
E T F買入	100		400			
国債補完供給	▲ 600	200		600		
当預増減	21,100		25,800		104,200	
当座預金残高	3,115,600		3,141,400		3,245,600	
準備預金残高	2,798,900					
積み終了先	2,362,600				12月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,362,500				積数	
非準備預金先	316,700				1日平均	
					0	
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	100.00%	日数	93.33%		

●2016年12月13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1兆1,000億円増の236兆7,000億円(当座預金残高見込みは31兆7,000億円)。本日の無担O/Nは基本的に強含みとなり、邦銀・証券業態による▲0.06~▲0.01%の出合いとなった。一巡後もビッドが残り、▲0.05~▲0.025%の出合いとなった。後場は特段の出合いが見られなかった。ターム物に関しては試し取りが見られ、ショートタームで0%が出合っていた。

<レポ市場>

GC T/N(12/14-12/15)は、▲0.095~▲0.08%程度の出合い。S/N(12/15-12/16)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/Nは、積み最終日等の要因がなどもあり、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物は引き続き低位で推移した。アウトライト市場は特段の出合いも無く、閑散な地合いが続いている。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は五・十日に係る発行となり、石油・不動産・機械業態でまとまった額の調達が行われ、償還・発行ともに3,000億円程度とやや膨らんだ。発行レートは低位横ばいの取引となった。また、CP等買入オペが前回と同額の4,500億円で実施された。応札額は9,156億円となり、平均落札利回▲0.004%、按分落札利回▲0.010%と前回よりも低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/12/13	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.096		0.080	0.010					
T/N			0.000				-	▲ 0.087								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.100								
2W							-	▲ 0.106								
3W							-	▲ 0.161								
1M							-	▲ 0.154								
3M							▲ 0.443	▲ 0.150								
6M							▲ 0.362	▲ 0.225								
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228								
										日付		12/6	12/7	12/8	12/9	12/12
										日銀当預残	3,115,700	3,119,300	3,113,800	3,125,500	3,094,500	
										準備預金残	2,806,400	2,799,800	2,801,700	2,810,800	2,795,200	
										マネタリーベース	4,142,500	4,147,300	4,144,200	4,158,100	4,128,000	
										無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.056%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.052%	
										コール市場残高	84,815	84,688	82,456	89,851	92,734	
										うち無担	63,730	63,029	60,547	67,666	71,358	
										うち有担	21,085	21,659	21,909	22,185	21,376	

●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・利回差	素分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
5年利付国債	130	0.10%	24,000	2016/12/20	2021/12/20	97,380.0	21,747.00	100.7900	▲0.0570%	53.0841%	100.8200	▲0.0630%	2,247.0

●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	2016/12/16			9,156	4,484	▲0.010		▲0.004	41.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)	33,187	2016/12/13	2016/12/14		557	557		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/12/15	2016/12/22	1.08	403	403				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)		
貸出増加支援オペ		貸付期間1年(借り換え)	2016/12/15	2017/12/15	0	5,842
貸出増加支援オペ		貸付期間4年(新規貸付)	2016/12/15	2020/12/15	0	53,971

●2016年12月14日の予定

*12月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*交付税金借入
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+10	(10,500億円、12/22借入)
*米国FOMC(2日目)	
*米国FRB経済見通し発表	
*米国10月の企業在庫	
*米国11月の生産者物価指数	
*米国11月の小売売上高	
*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率	

◆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場合があります。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