

# Central Daily Market Report

2016年12月14日(水)

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14日		2016年12月15日		2016年12月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 3,400		▲ 3,000	
財政	27,600		54,500		2,000	
資金過不足	25,600		51,100		▲ 1,000	
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						
国債買入					15,500	
CP等買入		▲ 100		▲ 800	4,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			59,800	▲ 13,000		
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	400		200			
国債補完供給	▲ 700	600		700		
当預増減	25,700		98,000		19,000	
当座預金残高	3,141,300		3,239,300		3,258,300	
準備預金残高	2,815,800					
積み終了先	2,378,100		12月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,378,100		積数		0	
非準備預金先	325,500		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	96.67%		

## ●2016年12月14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238兆4,000億円(当座預金残高見込みは314兆1,000億円)。本日の無担O/Nは昨日より更に強含みの展開となった。▲0.015%で寄付いた後は、邦銀・証券業態による▲0.04~▲0.005%のレンジで出合いが見られた。午後は調整から、▲0.065%の出合いが若干見られた。ターム物に関しては月内のショートタームで▲0.03~0%の出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(12/15-12/16)は、▲0.085~▲0.07%程度の出合い。S/N(12/16-12/19)は、▲0.095~▲0.09%程度の出合い。T/Nは、積み最終日等の要因から、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が上昇した。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。国債買入オペアが5本オファーされたことから、カレント近辺の銘柄を中心に、レートが変動する銘柄が多く見られた。

### <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動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

### <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、ノンバンク・建設業態から大型の発行が実施され、1,200億円程度の償還に対し、1,600億円程度の発行が見られた。発行レートは横ばい圏での決着となった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/12/14	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.092	0.055	▲ 0.025	19,253.61	3.09	115.19-22	114.98-00
T/N			0.000				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.230	▲ 0.018				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.163						
1M			0.001				-	▲ 0.155						
3M							▲ 0.442	▲ 0.150						
6M							▲ 0.359	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228						
									日付	12/7	12/8	12/9	12/12	12/13
									日銀当預残	3,119,300	3,113,800	3,125,500	3,094,500	3,115,600
									準備預金残	2,799,800	2,801,700	2,810,800	2,795,200	2,799,100
									マネタリーベース	4,147,300	4,144,200	4,158,100	4,128,000	4,151,600
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.053%	▲0.050%	▲0.052%	▲0.043%
									コール市場残高	84,688	82,456	89,851	92,734	91,796
									うち無担	63,029	60,547	67,666	71,358	73,441
									うち有担	21,659	21,909	22,185	21,376	18,355

## ●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	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)
交付税特会	-	-	10,500	2016/12/22	2017/6/22	113,513.0	10,500.04		0.0000%	9.2738%		0.0000%	

## ●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年超3年以下)	4,000	2016/12/16			8,746	4,004	▲0.014		▲0.012	76.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/12/16			9,628	4,201	▲0.034		▲0.023	79.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/12/16			9,410	4,102	▲0.041		▲0.032	53.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/12/16			6,382	2,002	▲0.034		▲0.029	59.4
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/12/16			3,683	1,202	▲0.075		▲0.065	95.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	64,759	2016/12/14	2016/12/15		675	675		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年12月15日の予定

*10月の石油等消費動態統計	*英中銀MPC結果発表 *米国11月の消費者物価指数	*国庫短期証券(652回)入札 (3ヶ月、44,000億円、12/19発行) *20年利付国債入札 (11,000億円、12/20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