Central Daily Market Report

2016年12月15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15日 需給速報		2016年12月16日 需給予想		2016年12月19日 当社予想	
銀行券	▲ 3,400		▲ 3,000		▲ 3,000	
財政	54,000		3,600		▲ 3,000	
資金過不足	50,600		600		▲ 6,000	
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					1,600	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			16,300			
CP等買入		▲ 800	4,500	▲ 200		
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						
ＥＴＦ買入	200		500			
国債補完供給	▲ 300	700		300		
当預増減	97,200		22,000		▲ 5,900	

当座預金残高	3,238,500	3,260,500	3,254,600
準備預金残高	2,907,200		
積み終了先	2,454,700		
超過準備	2,454,700		
非準備預金先	331,300		

12月16日以降の残り所要積立額	
積数	2,122,300
1日平均	70,700

積み期間（12/16～1/15）の所要準備額	2,122,300
準備預金進捗率　実績	0.00%　日数 0.00%

●2016年12月15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7兆5,000億円増の245兆円9,000億円(当座預金残高は323兆9,000億円)。本日の無担O/Nは引き続き堅調な展開となり、邦銀、証券業態による▲0.04～0%で出合いが見られた。一巡後も▲0.03～▲0.015%で散発的に調整の出合いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出合いが見られなかった。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物で8,000億円がオファーされ、結果は1,600億円（期落ち額1,510億円）で未達となった。

<レポ市場>

GC T/N(12/16-12/19)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N（12/19-12/20）は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/Nは、短国発行日等の要因があったものの、レートは横ばい圏内での取引となった。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、10Y344にビッドの出入りが多く見られ、O/N中心に締まったレベルでの取引となった。

<短国市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。アウトライト市場では3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.42%での出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.4196%、按分落札利回▲0.3925%と過去最低レートを更新する強い決着となった。セカンダリー市場では、▲0.415～▲0.395%で推移した。また、6M物では▲0.34%の出合いが見られた。

<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、ノンバンク業態から大型発行案件が実施され、600億円弱の償還に対して1,000億円程度の発行となった。発行レートは、引き続き横ばい圏での推移であった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/15	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.003	▲ 0.029				－	▲ 0.080
T/N							－	▲ 0.090
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.018				－	▲ 0.100
2W			▲ 0.005				－	▲ 0.173
3W							－	▲ 0.162
1M			▲ 0.030				－	▲ 0.155
3M							▲ 0.400	▲ 0.150
6M							▲ 0.356	▲ 0.225
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.075	0.020	19,273.79	20.18	117.21-24	117.62-66

日付	12/8	12/9	12/12	12/13	12/14
日銀当預残	3,113,800	3,125,500	3,094,500	3,115,600	3,141,300
準備預金残	2,801,700	2,810,800	2,795,200	2,799,100	2,816,400
マネタリーベース	4,144,200	4,158,100	4,128,000	4,151,600	4,179,400
無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.050%	▲0.052%	▲0.043%	▲0.034%
コール市場残高	82,456	89,851	92,734	91,796	94,824
うち無担	60,547	67,666	71,358	73,441	75,309
うち有担	21,909	22,185	21,376	18,355	19,515

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	652	－	44,300	2016/12/19	2017/3/27	141,810.0	40,112.5	100.1055	▲0.3925%	78.7931%	100.1128	▲0.4196%	4,187.0
20年利付国債	159	0.60%	11,000	2016/12/20	2036/12/20	33,233.0	9,931.0	99.0000	0.6560%	59.4576%	99.1900	0.6450%	1,059.0
預保借入(機能)	－	－	62	2016/12/27	2017/11/24	460.0	62.00		0.0000%	25.4090%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/12/19	2017/1/4		1,600	1,600				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	39,025	2016/12/15	2016/12/16		204	204		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	15,841	2016/12/15	2016/12/16		63	63		▲0.500	▲0.500	

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
被災地金融支援オペ	第68回	2016/12/22	2017/12/22	0	55
被災地金融支援オペ(熊本)	第7回	2016/12/22	2017/12/22	0	0

●2016年12月16日の予定

*米国11月の住宅着工件数
*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値
*国庫短期証券（653回）入札
（1年、25,000億円、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論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