Central Daily Market Report

2016年12月19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19日 需給速報		2016年12月20日 需給予想		2016年12月21日 当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 4,700		▲ 5,000	
財政	▲ 2,900		62,800		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 5,600		58,100		▲ 8,000	
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					12,500	
国債買入			4,200		12,300	
CP等買入		▲ 300		▲ 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				▲ 1,300		
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	▲ 5,700		60,700		16,800	

当座預金残高	3,254,200	3,314,900	3,331,700
準備預金残高	2,930,000		
積み終了先	2,460,100		
超過準備	2,443,900		
非準備預金先	324,200		

12月20日以降の残り所要積立額	
積数	43,900
1日平均	1,600

積み期間（12/16～1/15）の所要準備額			2,198,900
準備預金進捗率	実績	98.00%	日数 12.90%

●2016年12月19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1兆6,000億円減の247兆円1,000億円(当座預金残高は325兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・信託・証券業態を中心に▲0.045～▲0.025%で出合いが見られた。新しい積み期間の初日であった先週末より落ち着いた立ち上がりとなったが、一巡後も▲0.05～▲0.03%と堅調な出合いが見られた。ターム物は、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(12/20-12/21)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(12/21-12/22)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/Nは、短国・国債買入オペが入ったことから、オファーサイドの資金調達ニーズは薄くなっていた。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、2y370、5y128～129、10y330、333、335、340～345、30y52などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

短国現先レートT/Nは前日から横ばい圏の取引だった。短国アウトライト市場は、3M物で▲0.40%の出合いが小額見られた。短国買入オペは1兆2,500億円通知され、按分利回較差▲0.008%、平均利回較差0.010%、按分比率84.0%と、無難な結果となった。

<CP市場>

CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行総額2,300億円程度で、電力、機械、不動産、ノンバンク等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは0%近辺で低位安定であった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/19	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	0.001	▲ 0.036				－	▲ 0.095
T/N			0.010				－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.002	▲ 0.015				－	▲ 0.099
2W							－	▲ 0.176
3W			▲ 0.035				－	▲ 0.163
1M							－	▲ 0.155
3M							▲ 0.398	▲ 0.151
6M							▲ 0.338	▲ 0.225
1Y							▲ 0.317	▲ 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	0.000	19,391.60	▲ 9.55	117.80-83	117.34-35

日付		12/12	12/13	12/14	12/15	12/16
日銀当預残		3,094,500	3,115,600	3,141,300	3,238,500	3,259,900
準備預金残		2,795,200	2,799,100	2,816,400	2,907,900	2,927,100
マネタリーベース		4,128,000	4,151,600	4,179,400	4,279,900	4,304,400
無担O/N加重平均		▲0.052%	▲0.043%	▲0.034%	▲0.029%	▲0.037%
コール市場残高		92,734	91,796	94,824	91,752	91,626
	うち無担	71,358	73,441	75,309	71,705	71,328
	うち有担	21,376	18,355	19,515	20,047	20,298

●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）	応募額（億円）	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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
国庫短期証券買入	12,500	2016/12/21			23,900	12,500	▲0.008		0.010	84.0
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2016/12/21			8,232	4,002	▲0.012		▲0.009	98.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2016/12/21			8,894	4,202	▲0.016		▲0.010	20.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2016/12/21			15,356	4,105	▲0.009		▲0.006	19.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	39,371	2016/12/19	2016/12/20		111	111		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月20日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合　*黒田日銀総裁定例会見
（2日目、終了後直ちに結果公表）

◆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