Central Daily Market Report

2016年12月21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21日 需給速報		2016年12月22日 需給予想		2016年12月26日 当社予想	
銀行券	▲ 4,600		▲ 5,300		▲ 3,000	
財政	▲ 3,100		6,600		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 7,700		1,300		▲ 12,000	
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					2,700	▲ 2,000
国債買現						
国庫短期証買入	12,500					
国債買入	12,400					
CP等買入		▲ 600		▲ 500		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援			100			
社債等買入		▲ 100	1,300	▲ 100		
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 300	2,300		300		
当預増減	18,600		2,400		▲ 11,300	

当座預金残高	3,330,800	3,333,200	3,321,900
準備預金残高	2,986,800		
積み終了先	2,487,900		
超過準備	2,484,200		
非準備預金先	344,000		

12月22日以降の残り所要積立額	
積数	19,600
1日平均	800

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	99.11%	日数 19.35%

●2016年12月21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4,000億円増の250兆円(当座預金残高は333兆1,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは、▲0.025%の出合いで始まった。その後、国内勢より▲0.03～▲0.025%前後の調達で推移した。一巡後も調達サイドは底堅く、同水準の出合いが散見され、本日の取引を終了した。ターム物は、目立った出合いはなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(12/22-12/26)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/N(12/26-12/27)は、▲0.09～▲0.08%程度の出合い。S/Nは短国の発行要因から若干レート目線を引き上げたものの、引き続きオファーサイドの資金調達ニーズは薄くなっており、閑散とした引合いに終始した。SCは、新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄でビッドが入り、特に年末越えのタームでのビッドが多く見られていた。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3M物の入札は、平均落札利回▲0.4125%、按分落札利回▲0.3952%と堅調な結果で、セカンダリーでは▲0.45%の出合いが小額見られた。その他では1Y物で▲0.369～▲0.35%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は償還総額1,900億円程度に対し、発行総額2,000億円程度で、電機、機械、建設、化学等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは概ね0%近辺だったが、前日に続いて一部の年末越え物で積極的な買いニーズが見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/12/21	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.027				－	▲ 0.095
T/N							－	▲ 0.090
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				－	▲ 0.226
2W							－	▲ 0.179
3W							－	▲ 0.167
1M							－	▲ 0.149
3M							▲ 0.446	▲ 0.150
6M							▲ 0.348	▲ 0.225
1Y							▲ 0.364	▲ 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）
0.055	▲ 0.010	19,444.49	▲ 50.04	117.82-85	117.58-60

日付	12/14	12/15	12/16	12/19	12/20
日銀当預残	3,141,300	3,238,500	3,259,900	3,254,200	3,312,200
準備預金残	2,816,400	2,907,900	2,927,100	2,930,100	2,983,200
マネタリーベース	4,179,400	4,279,900	4,304,400	4,301,400	4,364,200
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.029%	▲0.037%	▲0.036%	▲0.032%
コール市場残高	94,824	91,752	91,626	92,326	100,639
うち無担	75,309	71,705	71,328	74,379	81,190
うち有担	19,515	20,047	20,298	17,947	19,449

●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	654	－	44,300	2016/12/26	2017/4/6	149,959.0	40,228.7	100.1095	▲0.3952%	57.6875%	100.1143	▲0.4125%	4,071.0
流動性供給	228	－	5,000	2016/12/26		17,988.0	4,985.00		▲0.0030%	28.1266%		▲0.0060%	

●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	2016/12/26	2017/1/10		2,652	2,652				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	16,812	2016/12/21	2016/12/22		255	255		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月22日の予定

*米国7-9月期のGDP確報値
*米国11月の個人所得・消費支出
*米国11月の耐久財新規受注

◆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