

# Central Daily Market Report

2016年12月27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27日	2016年12月28日	2016年12月29日			
	需給速報	需給予想	当社予想			
銀行券	▲ 2,500	▲ 2,600	▲ 3,000			
財政	3,000	▲ 1,300	▲ 3,000			
資金過不足	500	▲ 3,900	▲ 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						
国債買現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入	4,400					
CP等買入		▲ 1,100	▲ 1,600			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	400		800			
国債補完供給	▲ 300	100	300			
当預増減	11,400	▲ 4,400	▲ 6,000			
当座預金残高	3,326,500	3,322,100	3,316,100			
準備預金残高	2,993,700					
積み終了先	2,501,000			12月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,500,900			積数	6,200	
非準備預金先	332,800			1日平均	300	
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	99.72%	日数	38.71%		

## ●2016年12月27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2兆8,000億円増の250兆6,000億円(当座預金残高は332兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、邦銀・証券業態を中心に▲0.038~▲0.03%の出会いで立ち上がり。その後、出会いレートは▲0.065~▲0.04%を中心として、落ち着いた展開となった。一巡後は▲0.07~▲0.06%の水準で推移し本日の取引を終了した。ターム物の出会いは閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(12/28-12/29)は、▲0.09~▲0.085%程度のお合い。S/N(12/29-12/30)は、▲0.09~▲0.085%程度のお合い。T/N、S/Nともにほぼ横ばい圏での推移。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、引き続き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、5y 128~129、10y330、333、335、340~345、30y52などにビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移。アウトライト市場は参加者が少なく、閑散とされていた。

### <CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、償還総額1,700億円程度に対し、機械・ノンバンク業態から大型の発行案件がみられ、発行総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き低位横ばい圏での取引となった。CP等買入オペアがオファー額4,500億円で実施され、入札結果は平均落札利回▲0.007%、最低落札利回▲0.009%と、落ち着いた結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/12/27	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.091		0.060	0.005			117.19-23	117.31-33
T/N							-	▲ 0.089							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.263							
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.193							
3W							-	▲ 0.166							
1M							-	▲ 0.151							
3M							▲ 0.447	▲ 0.150							
6M							▲ 0.339	▲ 0.225							
1Y							▲ 0.356	▲ 0.228							
										日付	12/19	12/20	12/21	12/22	12/26
										日銀当預残	3,254,200	3,312,200	3,330,800	3,331,100	3,315,100
										準備預金残	2,930,100	2,983,200	2,986,800	2,997,400	2,977,000
										マネタリーベース	4,301,400	4,364,200	4,387,500	4,393,100	4,379,900
										無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.032%	▲0.027%	▲0.028%	▲0.041%
										コール市場残高	92,326	100,639	103,451	105,740	93,804
										うち無担	74,379	81,190	84,850	86,585	75,068
										うち有担	17,947	19,449	18,601	19,155	18,736

## ●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	棄分率	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)
2年利付国債	372	0.10%		2017/1/16	2019/1/15	94,497.0	20,942.00	100.5100	▲0.1540%	34.7133%	100.5160	▲0.1570%	2,051.0

## ●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	応募総額(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	2016/12/30			13,755	4,495	▲0.009		▲0.007	47
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	19,146	2016/12/27	2016/12/28		323	323		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年12月28日の予定

*11月の商業動態統計速報	*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想：前月比+1.6%)
---------------	---------------------------------------

◆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