Central Daily Market Report

2016年12月29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29日 需給速報		2016年12月30日 需給予想		2017年1月4日 当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 100		6,000	
財政	▲ 11,700		▲ 6,700		0	
資金過不足	▲ 13,900		▲ 6,800		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					1,300	▲ 1,600
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,100		12,300	
CP等買入		▲ 500	4,500	▲ 3,800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 200	1,400		200		
当預増減	▲ 13,200		▲ 1,100		18,000	

当座預金残高	3,309,600	3,308,500	3,326,500
準備預金残高	2,986,200		
積み終了先	2,497,300		
超過準備	2,497,300		
非準備預金先	323,400		

12月30日以降の残り所要積立額	
積数	4,400
1日平均	300

積み期間（12/16～1/15）の所要準備額			2,198,800
準備預金進捗率	実績	99.80%	日数 45.16%

●2016年12月29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7,000億円減の249兆6,000億円(当座預金残高は331兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀・信託・証券業態を中心に▲0.07～▲0.04%の出合いで始まった。調達側に取り急ぐ動きは無く、一巡後もほぼ同水準での調達が散見され、本日の取引を終了した。年末初物となるT/Nは、▲0.07%台の出合いが見られた。共通担保オペが8,000億円オファーされ、応札は1,300億円（期落ち額1,600億円）で札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(12/30-1/4)は、▲0.25～▲0.20%程度の出合い。S/N（1/4-1/5）は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。S/Nは末初要因が剥落したことで、レートを大きく戻し、安定的に推移した。SCは、個別銘柄では、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>

現先T/Nは年末初の取引にあたり、レートは大幅に低下した。アウトライト市場は受け渡しが年明けとなった事もあり、売り物が散見されたが、出合いは3M物で▲0.40%が小額見られた程度と閑散であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移。CP市場は、年末休暇入りした事業法人が多いものの、月初発行の案件が複数見られ、ノンバンク・石油業態からの大型案件等により発行総額は1,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの取引となった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/29	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.048				－	▲ 0.093
T/N	▲ 0.075	▲ 0.040	▲ 0.067				－	▲ 0.247
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				－	▲ 0.105
2W			▲ 0.035				－	▲ 0.105
3W							－	▲ 0.107
1M							－	▲ 0.115
3M							▲ 0.411	▲ 0.161
6M							▲ 0.317	▲ 0.225
1Y							▲ 0.326	▲ 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）
0.040	▲ 0.015	19,145.14	▲ 256.58	117.06-08	116.36-37

日付		12/21	12/22	12/26	12/27	12/28
日銀当預残		3,330,800	3,331,100	3,315,100	3,326,500	3,322,800
準備預金残		2,986,800	2,997,400	2,977,000	2,995,100	2,995,800
マネタリーベース		4,387,500	4,393,100	4,379,900	4,393,900	4,392,700
無担O/N加重平均		▲0.027%	▲0.028%	▲0.041%	▲0.048%	▲0.046%
コール市場残高		103,451	105,740	93,804	102,313	98,652
	うち無担	84,850	86,585	75,068	81,326	78,717
	うち有担	18,601	19,155	18,736	20,987	19,935

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2017/1/4	2017/1/16		1,300	1,300				
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2017/1/4			7,523	4,004	▲0.007		▲0.005	62.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2017/1/4			11,733	4,204	▲0.010		▲0.009	86.1
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,100	2017/1/4			13,909	4,106	▲0.010		▲0.008	26.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	9,213	2016/12/29	2016/12/30		164	164		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月30日の予定

*証券取引所大納会　　*米国12月のシカゴPM景況感指数

◆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