Central Daily Market Report

2016年12月28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28日 需給速報		2016年12月29日 需給予想		2016年12月30日 当社予想	
銀行券	▲ 2,600		▲ 2,300		▲ 900	
財政	800		▲ 11,400		▲ 3,300	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 13,700		▲ 4,200	
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						
国債買入					4,000	
CP等買入		▲ 1,600		▲ 500	4,500	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	800					
国債補完供給	▲ 1,400	300		1,400		
当預増減	▲ 3,700		▲ 12,800		4,300	

当座預金残高	3,322,800	3,310,000	3,314,300
準備預金残高	2,995,800		
積み終了先	2,505,700		
超過準備	2,505,700		
非準備預金先	327,000		

12月29日以降の残り所要積立額	
積数	5,500
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	99.75%	日数 41.94%

●2016年12月28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3,000億円減の250兆3,000億円(当座預金残高は332兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、邦銀・証券業態を中心に▲0.04～▲0.035%の出合いで立ち上がり。その後は、信託業態も加わり▲0.06～▲0.045%を中心とした出合い。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。ターム物の出合いは閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(12/29-12/30)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(12/30-1/4)は、▲0.40～▲0.20%程度の出合い。S/Nは末初物の取引にあたり、思惑が交錯し、幅広いレンジでのレート推移となっている。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S/N物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取引材料も特段なく、終始閑散で出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。CP発行市場は償還1兆9,000億円程度に対し、発行5,000億円程度となった。本日は2営業日後が年末営業日にあたるため、幅広い業態から発行が見られる中、鉄鋼・ノンバンク・機械業態で大型発行が実施された。しかし、年末償還銘柄の残高が大きく、例年と同様に大幅な償還超となった。発行レートは0%近辺で決着する銘柄が大半であった。

●短期金融市場関連指標

2016/12/28	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	▲ 0.046				－	▲ 0.091
T/N	▲ 0.070	▲ 0.030	▲ 0.058				－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.299
2W							－	▲ 0.199
3W							－	▲ 0.167
1M							－	▲ 0.150
3M							▲ 0.432	▲ 0.150
6M							▲ 0.326	▲ 0.225
1Y							▲ 0.338	▲ 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	▲ 0.005	19,401.72	▲ 1.34	117.48-51	117.50-52

日付		12/20	12/21	12/22	12/26	12/27
日銀当預残		3,312,200	3,330,800	3,331,100	3,315,100	3,326,500
準備預金残		2,983,200	2,986,800	2,997,400	2,977,000	2,995,100
マネタリーベース		4,364,200	4,387,500	4,393,100	4,379,900	4,393,900
無担O/N加重平均		▲0.032%	▲0.027%	▲0.028%	▲0.041%	▲0.048%
コール市場残高		100,639	103,451	105,740	93,804	102,313
	うち無担	81,190	84,850	86,585	75,068	81,326
	うち有担	19,449	18,601	19,155	18,736	20,987

●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
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,900	2016/12/30			5,673	1,905	0.006		0.008	48.3
国債買入（残存期間25年超）	1,100	2016/12/30			3,408	1,103	0.010		0.012	59.6
国債買入（変動利付債）	1,000	2016/12/30			4,354	1,001	▲0.120		▲0.148	89.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	42,843	2016/12/28	2016/12/29		1,290	1,290		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	427	2016/12/28	2016/12/29		5	5		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/12/30	2017/1/6	1.06	1,223	1,223				

●2016年12月29日の予定

＊日銀金融政策決定会合における主な意見（12月20、21日分）

◆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