

《資金需給》

単位 億円

	12日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 3,300	▲ 1,100	▲ 2,000
財政		▲ 5,400	15,600	0
資金過不足		▲ 8,700	14,500	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,800		
81,067		▲ 2,600		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証券買入				5,000
国庫短期証券売却				
国債買入		13,700		13,000
CP等買入		▲ 500	▲ 1,200	
貸出支援基金(成長)				31,800
44,583				
(増加) 159,053				▲ 1,100
被災地支援				
3,246				
社債等買入				
ETF買入		200	100	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		14,500	▲ 1,000	48,700
当増減		5,800	13,500	46,700

《 12/15の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,691,700	前日比	13,500
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.065%近辺の出合いが中心になると見込まれる。					

《 12日のインターバンク市場動向 》

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆7,000億円増の129兆5,000億円(当座預金残高見込みは167兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.067~0.068%での調達、大手行からは0.065%での調達希望で始まった。その後も、週末要因により、やや強めの展開が続くなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

《 12日のオープン市場動向 》

現先S/N物は小幅低下した。本日は短国買入オペが前回比2,500億円減額となる5,000億円で開催された。落札結果は、按分・平均利回り較差共に+0.013%と、今後の短国買入オペ動向が不透明なことから、売却意欲の強さが反映された結果となった。オペ後は、セカンダリー市場で3M物で0%の出合いが見られたものの、売り一巡後は一転して▲0.009%まで買い進まれた。CP市場は償還総額1,600億円に対して発行総額は1,500億円弱となった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

《 15日の材料 》

- \*12月調査の日銀短観(概要及び要旨)
- 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+13
- \*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率

当座預金残高	1,678,200	12/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,526,400		3,300
積み終了先	1,288,200	12/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,288,200	積数	200
非準預先残高	151,800	1日平均	200
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,887,600
準備預金進捗率	99.99% (実績)	96.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.395	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,371.58	114.18	為替(9時)	118.99-01
						為替(5時)	118.76-78

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	12/5	12/8	12/9	12/10	12/11	12/12
日銀当預残	1,681,000	1,663,900	1,686,600	1,673,300	1,672,400	1,678,200
準備預金残	1,537,200	1,522,500	1,539,400	1,528,900	1,516,400	1,526,400
レート	0.067%	0.065%	0.073%	0.067%	0.085%	0.068%
月中平均	0.06586%	0.06575%	0.06656%	0.06660%	0.06827%	0.06821%

12/11のマナターベース			2,608,300			
12/11コール	合計	202,173	無担	81,473	有担	120,700
コール前日増減	計	5,805	無担	6,906	有担	▲ 1,101

12/12の加重平均レート(速報)				12/11の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		CP気配a-1	短国	無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)						O/N	0.055 ~0.135 (0.085)	
0.062 ~0.125 (0.080)					T/N		0.065 ~0.130 (0.094)		
0.125 (0.125)					S/N		0.125 (0.125)		
0.056 ~0.250 (0.113)					1W	0.250 (0.250)	0.075 (0.075)		
0.118 ~0.340 (0.120)					2W		0.160 (0.160)		
					3W				
					1M		0.200 ~0.230 (0.223)	有担先日付分	
					2M				
					3M				
					6M				
					1Y				

《オベ情報、入札結果》

国債補完	2,000億円	12/12 ~ 12/15 (3日間)	応札	23億円	落札	23億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債補完	7,687億円	12/12 ~ 12/15 (3日間)	応札	71億円	落札	71億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	5,000億円	12/16	応札	26,454億円	落札	5,000億円	全取利回り較差	0.013%	平均利回り較差	0.013%	
国債買入	4,500億円	12/16	応札	11,613億円	落札	4,504億円	按分利回り較差	0.006%	22.2%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,500億円	12/16	応札	12,331億円	落札	4,506億円	按分利回り較差	0.003%	51.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,500億円	12/16	応札	10,238億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.006%	26.4%	平均利回り較差	-0.004%
貸出増加支援	12/16~2015/12/16 (365日間)	貸付予定総額	479億円	貸付利率	0.10%						
貸出増加支援	12/16~2016/12/15 (730日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%						
貸出増加支援	12/16~2017/12/15 (1095日間)	貸付予定総額	32億円	貸付利率	0.10%						
貸出増加支援	12/16~2018/12/14 (1459日間)	貸付予定総額	31336億円	貸付利率	0.10%						

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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