

◀資金需給▶

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100	▲ 1,800	▲ 3,000		
財政		15,700	3,300	0		
資金過不足		14,600	1,500	▲ 3,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		81,067				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入			5,000			
国庫短期証売却						
国債買入			13,200			
CP等買入						
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 159,053		▲ 1,200	▲ 400			
被災地支援			31,800			
			▲ 1,100			
被災地支援		3,246				
社債等買入			▲ 100	800		
ETF買入		100	300			
国債補完供給	即日	▲ 200				
		100	200			
小計		▲ 1,200	48,900	800		
当増減		13,400	50,400	▲ 2,200		

◀ 12/16の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,742,000	前日比	50,400
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。

◀ 15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、前営業日比1兆円減の128兆5,000億円(当座預金残高見込みは169兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.065~0.068%での調達と、やや強めの地合いで始まった。年金定時払いにより大幅な余剰日となったものの、積み最終日という事もあって終日、同水準での取引が続いた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

◀ 15日のオープン市場動向 ▶  
 現先S/N物は横ばい圏で推移となった。短国市場は材料なく閑散。3Mで▲0.005~▲0.001%で少額の出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額3,000億円に対し、機械業態からまとまった発行案件が見られたものの、発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

◀ 16日の材料 ▶  
 \*米国FOMC(1日目)  
 \*米国11月の住宅着工件数  
 \*英国11月の消費者物価指数  
 \*5年利付国債入札(27,000億円、12/22発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、12/25借入)

◀コール11月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.06747%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06735%	有担 0.03100%

当座預金残高	1,691,600	12/15以降の残り所要積立額	200
準備預金残高	1,549,700	12/16以降の残り所要積立額	積数 1,964,200
積み終了先	1,296,000	1日平均	63,400
超過準備	1,295,800	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,887,600
非準預先残高	141,900	12月の新所要見込	63,400 (一日平均)

JGB新発10年債	0.375	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	17,099.40	▲ 272.18	為替(9時)	118.16-18
						為替(5時)	118.22-24

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	12/8	12/9	12/10	12/11	12/12	12/15
日銀当預残	1,663,900	1,686,600	1,673,300	1,672,400	1,678,200	1,691,600
準備預金残	1,522,500	1,539,400	1,528,900	1,516,400	1,529,800	1,549,700
レート	0.065%	0.073%	0.067%	0.085%	0.068%	0.069%
月中平均	0.06575%	0.06656%	0.06660%	0.06827%	0.06821%	0.06827%

12/12のマナターベース				2,617,500	
12/12コール	合計	195,373	無担	74,341	有担 121,032
コール前日増減	計	▲ 6,800	無担	▲ 7,132	有担 332

12/15の加重平均レート(速報)				12/12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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.050 ~0.125 (0.069)	0.030 ~0.040 (0.031)					0.050 ~0.135 (0.068)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.063 ~0.120 (0.067)						T/N	0.062 ~0.125 (0.080)		
						S/N	0.125 (0.125)		
0.115 ~0.260 (0.163)						1W	0.056 ~0.250 (0.113)		
0.116 ~0.240 (0.120)						2W	0.118 ~0.340 (0.120)		
						3W			
0.240 ~0.290 (0.265)				0.08-0.12	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	▲0.005-▲0.001	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	6,000億円	12/15	~ 12/16 (1日間)	応札	203億円	落札	203億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	1,100億円	12/22	応札	2,828億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	-0.004%	60.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,400億円	12/22	応札	5,841億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.023%	65.8%	平均利回り較差	-0.020%
国債買入	1,600億円	12/22	応札	5,357億円	落札	1,606億円	按分利回り較差	-0.015%	71.9%	平均利回り較差	-0.013%

ETF買入 374億円 約定日 12/15

「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