

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想		18日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,900	▲ 2,800	▲ 5,000		
財政		3,900	1,700	1,000		
資金過不足		2,000	▲ 1,100	▲ 4,000		
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						
		▲ 400	▲ 500			
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789		31,800				
		▲ 1,100				
被災地支援 3,246						
社債等買入		▲ 100	800	▲ 100		
ETF買入		300	100			
国債補充供給		200				
小計		48,900	300	0		
当増減		50,900	▲ 800	▲ 4,000		

当座預金残高	1,742,500	12/16以降の残り所要積立額	1,964,200
準備預金残高	1,587,000		
積み終了先	397,500	12/17以降の残り所要積立額	948,500
超過準備	317,900	積数	31.600
非準備先残高	155,000	1日平均	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,964,200
準備預金進捗率	51.71%	(実績)	3.23% (日数)

12/15のマネタリーベース		2,631,900	
12/15コール 合計	194,688	無担	71,587
コール前日増減	計	▲ 685	無担 ▲ 2,754
			有担 2,069

12/16の加重平均レート(速報)				12/15の加重平均レート(確報)			
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
0.055 ~0.125 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)					0.050 ~0.125 (0.069)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.063 ~0.125 (0.073)							
0.117 ~0.300 (0.187)							
0.118 (0.118)							
0.310 (0.310)							
0.175 (0.175)				0.08-0.12	-		0.240 ~0.290 (0.265)
				0.08-0.12	-		
0.200 (0.200)				0.08-0.12	▲0.005-▲0.001		
				-	-		
				-	▲0.014		

《オペ情報、入札結果》

CP買入 4,500億円 12/19 応札 13,366億円 落札 4,476億円 按分レート 0.087% 43.2% 平均落札レート 0.108%

米ドル資金供給(固定金利方式) 12/18~12/29 (11日間) 応札 3,000万ドル 落札 3,000万ドル 貸付利率 0.600%

5年利付国債(表面利率0.1%) 応札10兆5,366億円 落札2兆4,872億円(I非競争入札:2,109億円) 12/22~2019/12/20 0.083% 按分99.8817% 平均0.083%

交付税特会 1兆500億円 12/25~2015/6/25 応札 2兆7,293億円 落札 1兆500億100万円 0.090% 按分 72.7440% 平均 0.088%

ETF買入 374億円 約定日 12/16

J-REIT買入 13億円 約定日 12/16

12/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,741,700	前日比	▲ 800
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。

《16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、133兆9,000億円(当座預金残高見込みは174兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.063~0.065%、地銀業態から0.063%、大手行からは0.06%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.065%と昨日よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は0.06%前半での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、ロール案件の出合いが数件見られる程度であった。

《16日のオープン市場動向》

現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、3Mで▲0.005~▲0.001%で調整の出合いが見られた程度で、総じて閑散であった。CP市場は、500億円程度の償還に対して、1,000億円程度の発行となった。発行レートは概ね横ばいであった。CP等買入オペが4,500億円実施され、平均落札利回り0.108%、按分落札利回り0.087%となり、それぞれ前回比で上昇した。

《17日の材料》

- *11月の貿易統計
- *米国FOMC(2日目) *米国FRB経済見通し発表
- *米国11月の消費者物価指数
- *ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値
- *ECB定例理事会(金融政策発表なし)
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、12/22発行)

《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%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.76-77
0.360 ▲0.015	16,755.32 ▲344.08	為替(5時)	117.33-35

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	12/9	12/10	12/11	12/12	12/15	12/16
日銀当座預金	1,686,600	1,673,300	1,672,400	1,678,200	1,691,600	1,742,500
準備預金残	1,539,400	1,528,900	1,516,400	1,529,800	1,550,400	1,587,000
レート	0.073%	0.067%	0.085%	0.068%	0.069%	0.067%
月中平均	0.06656%	0.06660%	0.06827%	0.06821%	0.06827%	0.06819%

「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