

◀資金需給▶

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,800	▲ 4,100	▲ 5,000		
財政		3,900	7,500	▲ 1,000		
資金過不足		1,100	3,400	▲ 6,000		
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						
国庫短期証売却						
国債買入						
CP等買入				4,500		
貸出支援基金(成長)		44,583				
(増加)		189,789				
被災地支援		3,246				
社債等買入		800				
社債等買入		▲ 100				
ETF買入		100	300			
国債補充供給						
小計		300	100	4,500		
当増減		1,400	3,500	▲ 1,500		

当座預金残高	1,743,900	12/17以降の残り所要積立額	948,400
準備預金残高	1,585,400		
積み終了先	1,055,300	12/18以降の残り所要積立額	292,500
超過準備	676,500	積数	10,100
非準備先残高	158,500	1日平均	10,100
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	85.11%	(実績)	6.45%
		(日数)	

12/16のマネタリーベース		2,684,800	
12/16コール 合計	200,678	無担	80,328
コール前日増減	計	5,990	▲ 2,751

12/17の加重平均レート(速報)				12/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.055 ~0.125 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.062 ~0.120 (0.067)				T/N			
				S/N			
0.117 ~0.230 (0.127)				1W		0.117 ~0.300 (0.187)	
0.117 (0.117)				2W	0.118 (0.118)		
0.117 (0.117)				3W		0.310 (0.310)	
0.117 ~0.230 (0.155)		0.08-0.12	-	1M	0.175 (0.175)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.005	3M		0.200 (0.200)	
		-	-	6M			
		-	▲0.061-▲0.004	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	4,500億円	12/22	応札	10,754億円	落札	4,501億円	按分利回り較差	-0.001%	23.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,500億円	12/22	応札	8,743億円	落札	4,501億円	按分利回り較差	-0.008%	38.1%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	4,000億円	12/22	応札	10,244億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.012%	18.9%	平均利回り較差	-0.008%

T-Bill1Y 応札18兆4,295億円 落札2兆3,208億6,000万円(非競争入札:1,791億円) 12/22~2015/12/21 ▲0.0040% 按分15.9789% 平均 ▲0.0050%

「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

◀ 12/18の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,747,400	前日比	3,500
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。

◀ 17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、133兆2,000億円(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0.064%、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0.064~0.065%となった。また、一部邦銀が試し取りを行った。一巡後は調達レートを切り下げ、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、本日も目立った出合いは見られなかった。

◀ 17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。短国市場では、1Y物(501回)の入札が実施された。落札結果は平均落札利回り▲0.0050%、按分落札利回り▲0.0040%と堅調な結果になった。セカンダリーは▲0.061~▲0.03%の出合いが見られた。CP市場は2,700億円程度の償還に対して、鉄鋼・ノンバンク業態などから大型発行案件が見られ、総額3,500億円程度の発行となった。発行レートは総じて横ばいであった。

◀ 18日の材料 ▶
*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)
*ECB定例理事会(金融政策発表なし)
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、12/22発行)
*20年利付国債入札(12,000億円、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	0.355	▲0.005	日経平均株価(終値)	16,819.73	64.41	為替(9時)	116.61-64
						為替(5時)	117.40-41

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	12/10	12/11	12/12	12/15	12/16	12/17
日銀当座預金	1,673,300	1,672,400	1,678,200	1,691,600	1,742,500	1,743,900
準備預金残	1,528,900	1,516,400	1,529,800	1,550,400	1,587,400	1,585,400
レート	0.067%	0.085%	0.068%	0.069%	0.067%	0.068%
月中平均	0.06660%	0.06827%	0.06821%	0.06827%	0.06819%	0.06818%