

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,100	▲ 1,600	0
財政		3,200	6,600	▲ 4,000
資金過不足		1,100	5,000	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				500
64,615				▲ 600
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			4,900	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金			11,000	
(成長) 51,505				
(増加) 252,028			▲ 6,800	
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入			500	
国債補完供給		100		
小計		0	9,200	▲ 100
当預増減		1,100	14,200	▲ 4,100

当座預金残高	2,380,600	12/3以降の残り所要積立額	4,500
準備預金残高	2,171,700	12/4以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,773,700	積数	3,500
超過準備	1,773,600	1日平均	300
非準備先残高	208,900	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,961,300
準備預金進捗率	99.82% (実績)		60.00% (日数)

12/2のマナタリーベース		3,359,300	
12/2コール	合計	201,471	無担 63,008 有担 138,463
コール前日増減	計	2,517	無担 2,953 有担 ▲ 436

12/3の加重平均レート(速報)				12/2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	無担先日付分	有担当日分	単位(%)
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.075 ~0.121 (0.078)					0.073 ~0.121 (0.078)		
0.101 ~0.117 (0.116)					0.117 ~0.130 (0.124)		
0.118 (0.118)					0.310 (0.310)		
0.117 ~0.170 (0.126)		0.07~0.12	-				有担先日付分
		0.07~0.11	-				
		0.07~0.11	▲0.08-▲0.07				
		-	-				
		-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 8,000億円 12/7 ~ 3/7 (91日間) 応札 450億円 落札 450億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札 18兆5,995億円 落札 4兆4,054億2,000万円(非競争入札:3,745億円) 12/7~2016/3/14 ▲0.0502% 按分3.9952% 平均▲0.0644%  
 流動性供給 応札 9,400億円 落札 2,994億円 12/7 募入最大利回較差 ▲0.003% 按分 61.7318% 募入平均利回較差 ▲0.006%  
 交付税特会 1兆500億円 12/11~2016/6/10 応札 3兆1,200億円 落札 1兆500億円 0.064% 按分 61.9048% 平均 0.063%  
 ETF買入 369億円 約定日 12/3  
 J-REIT買入 12億円 約定日 12/3

<< 12/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,394,800	前日比	14,200
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 3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2,000億円減の177兆4,000億円(当座預金残高見込みは、238兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.075~0.077%、大手行からは0.075%の調達希望。出合いの中心は0.075~0.077%と昨日よりもやや弱めの立ち上がりとなった。また、昨日に続き、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後はビッドが薄くなり、0.07~0.075%での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

**<< 3日のオープン市場動向 >>**  
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引での強めの気配を受け、入札結果は平均落札利回り▲0.0644%・按分落札利回り▲0.0502%となり、3M物では過去最低の按分利回りとなった。セカンダリー市場は▲0.07%近辺で推移した。CP市場は幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は1,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き低位横ばい圏での動きとなった。

- << 4日の材料 >>**
- \*10月の毎月勤労統計調査速報
  - \*11月の消費動向調査
  - \*米国10月の貿易収支
  - \*米国11月の雇用統計

<<コール11月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07763%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07811%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.315	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	19,939.90	1.77	為替(9時)	123.24-25
						為替(5時)	123.37-39

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	11/26	11/27	11/30	12/1	12/2	12/3
日銀当預残	2,458,300	2,439,900	2,458,600	2,444,100	2,379,500	2,380,600
準備預金残	2,241,800	2,222,300	2,249,100	2,233,300	2,169,700	2,171,700
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%
月中平均	0.07777%	0.07769%	0.07763%	0.07600%	0.07650%	0.07667%

「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