

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	▲ 1,400	▲ 3,000
財政		▲ 6,200	4,500	▲ 13,000
資金過不足		▲ 7,500	3,100	▲ 16,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		13,200		
68,285		▲ 9,400		
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		11,000		
CP等買入			5,000	
		▲ 300	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		300	500	
国債補完供給				
小計		19,700	5,300	0
当増減		12,200	8,400	▲ 16,000

<< 12/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,413,900	前日比	8,400
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。

<< 8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1兆9,000億円増の180兆7,000億円(当座預金残高見込みは、240兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.074~0.076%、大手行からは0.075%の調達希望。出合いの中心は0.075~0.076%と昨日と同様やや弱めの立ち上がりとなった。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後は調達レートが低下し、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、昨日に続き大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 8日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は6M物の入札が実施され、平均落札利回▲0.0458%、按分落札利回▲0.0378%と引続き強含みの結果となった。その他は、様子見閑散の状態であった。CP市場は、五・十日発行にあたり、電気機器、建設業態等からまとまった発行が実施され、発行総額は3,500億円程度となり、償還総額1,400億程度を上回った。引続き期を越える物に対する投資家の買いニーズが強く、期越物のレートは低下余地を探る展開となった。

- << 9日の材料 >>
- *10月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.5%)
 - *10月の特定サービス産業動態統計速報
 - *11月のマネーストック
 - *米国10月の卸売売上高
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、12/17借入)

当座預金残高	2,405,500	12/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,188,500		1,500
積み終了先	1,800,400	12/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,800,400	積数	1,300
非準預先残高	217,000	1日平均	200
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,969,500		
準備預金進捗率	99.93% (実績)	76.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.311	▲ 0.014	日経平均株価(終値)	19,492.60	▲ 205.55	為替(9時)	123.30-31
						為替(5時)	123.10-11

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	12/1	12/2	12/3	12/4	12/7	12/8
日銀当預残	2,444,100	2,379,500	2,380,600	2,394,700	2,393,300	2,405,500
準備預金残	2,233,300	2,169,700	2,171,800	2,182,900	2,173,100	2,188,500
レート	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07643%	0.07638%

12/7のマネタリーベース				3,377,000		
12/7コール	合計	216,223	無担	73,424	有担	142,799
コール前日増減	計	3,129	無担	619	有担	2,510

12/8の加重平均レート(速報)				12/7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	
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)
0.074 ~0.121 (0.077)						T/N		0.074	~0.121 (0.077)
						S/N			
0.117 ~0.130 (0.120)						1W		0.081	~0.155 (0.108)
0.065 ~0.165 (0.114)						2W		0.073	~0.160 (0.116)
						3W			
				0.07-0.12	-	1M		0.170	(0.170)
				0.07-0.11	-	2M			
				0.07-0.11	-	3M			
				-	▲0.065-▲0.05	6M			
				-	-	1Y			

<<オベ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 12/8 ~ 12/9 (1日間) 0億円 0億円 按分 平均 (即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 12/10~12/17 (7日間) 応札300万ドル 落札300万ドル 貸付利率 0.630%
 T-Bill6M 応札13兆7,895億円 落札3兆2,188億8,000万円(非競争入札:2,811億円) 12/10~2016/6/10 ▲0.0378% 按分32.9333% 平均▲0.0458%
 30年利付国債(表面利率1.4%) 応札2兆8,687億円 落札7,292億円(I非競争入札:700億円) 12/21~2045/12/20 1.400% 按分79.2810% 平均1.397%
 ETF買入 369億円 約定日 12/9

「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