

《資金需給》

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想		11日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 3,100	▲ 3,000		
財政		2,500	▲ 12,600	▲ 1,000		
資金過不足		1,100	▲ 15,700	▲ 4,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					10,400	
68,285					▲ 8,500	
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					7,800	
CP等買入						
		5,000				
		▲ 200	▲ 400			
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						
ETF買入		500	200			
国債補充供給						
小計		5,300	▲ 200		9,700	
当預増減		6,400	▲ 15,900		5,700	

《 12/10の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,396,000	前日比	▲ 15,900
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。					

《 9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7,000億円増の181兆4,000億円(当座預金残高見込みは、241兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託の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、昨日に続き大手行が1W物0.117%で調達を行った。

《 9日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、6Mで▲0.065~▲0.06%の出合いが見られた程度で、引き続き動意に乏しく、閑散とした地合いであった。CP発行市場は、2,800億円程度の償還に対して、1,400億円程度の発行で、機械業態から大型発行案件が見られた。発行レートは、依然として投資家の運用ニーズは堅調なこともあり、落ち着いた水準での決着が中心となった。

- 《 10日の材料 》
- *10-12月期の法人企業景気予測調査季報
 - *11月の企業物価指数
 - *米国11月の財政収支
 - *英中銀MPC結果発表
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、12/14発行)
 - *流動性供給入札(5,000億円、12/14発行)
 - *預金保険機構借入(12ヶ月程度、22日借入)

当座預金残高	2,411,900	12/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,202,200		1,300
積み終了先	1,813,600	12/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,813,600	積数	1,100
非準備先残高	209,700	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	99.94% (実績)	80.00% (日数)	

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	122.92-93
0.305	▲ 0.006	19,301.07	▲ 191.53	為替(5時)	122.71-73

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	12/2	12/3	12/4	12/7	12/8	12/9
日銀当預残	2,379,500	2,380,600	2,394,700	2,393,300	2,405,500	2,411,900
準備預金残	2,169,700	2,171,800	2,182,900	2,173,100	2,188,500	2,202,200
レート	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07643%	0.07638%	0.07633%

12/8のマナターベース			3,390,600			
12/8コール	合計	225,749	無担	81,754	有担	143,995
コール前日増減	計	9,526	無担	8,330	有担	1,196

12/9の加重平均レート(速報)				12/8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)	0.074 ~ 0.125 (0.082)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~ 0.125 (0.076)	
					T/N		0.074 ~ 0.121 (0.077)		
					S/N				
					1W		0.117 ~ 0.130 (0.119)		
0.117 ~ 0.125 (0.117)	0.310 (0.310)				2W	0.160 (0.160)	0.065 ~ 0.165 (0.117)		
					3W				
					1M				有担先日付分
					2M				
					3M				
					6M	▲0.065-▲0.06			
					1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	12/11 ~ 3/22 (102日間)	応札	10,400億円	落札	10,400億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	4,000億円	12/11	応札	10,029億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	-0.005%	23.5%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	2,400億円	12/11	応札	7,320億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	-0.011%	7.4%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	1,400億円	12/11	応札	3,709億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.013%	8.1%	平均利回り較差	-0.008%
交付税特会	1兆500億円	12/17~2016/6/17	応札	2兆7,825億円	落札	1兆500億円	0.090%	按分	27.5000%	平均	0.070%
ETF買入	369億円	約定日	12/9								
J-REIT買入	12億円	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