

<<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