

◀資金需給▶

単位 億円

	16日需給速報	17日需給予想	18日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 2,300	▲ 4,000	▲ 5,000
財政	▲ 200	2,900	2,000
資金過不足	▲ 2,500	▲ 1,100	▲ 3,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)			2,400
70,175			▲ 9,200
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	8,300		11,000
CP等買入			5,500
貸出支援基金	▲ 500	▲ 300	
(成長) 58,484	20,200		
(増加) 271,714	▲ 11,200		
被災地支援			
3,161			
社債等買入		▲ 100	
ETF買入			
国債補完供給	▲ 100	100	
小計	16,700	▲ 300	9,700
当預増減	14,200	▲ 1,400	6,700

◀ 12/17の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,474.800	前日比	▲ 1.400
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。					

◀ 16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1兆6,000億円増の186兆2,000億円(当座預金残高見込みは、247兆8,000億円)。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。一巡後は徐々にビッドが消え、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、目立った出合いは見られなかった。

◀ 16日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は1Y物の入札が実施された。短国買入オペ等の先行き不透明感があつたものの、平均落札利回▲0.0489%、最高落札利回▲0.0409%と積極的な応札が見られ、引続き強めの結果となった。セカンダリーは▲0.09%まで買い進まれた。CP市場は20日にかかる発行となり石油、鉄鋼、電力業態からまとまった発行が見られ総額2,800億円程度に膨らんだ。発行レートは引続き低位横ばいで推移した。

- ◀ 17日の材料 ▶
- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、18日まで)
  - \*11月の貿易統計
  - \*7~9月期の資金循環統計速報
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、12/21発行)
  - \*20年利付国債入札(12,000億円、12/21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	0.07697%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07714%	有担 0.03100%

当座預金残高	2,476,200	12/16以降の残り所要積立額	2,040,700
準備預金残高	2,264,600	12/17以降の残り所要積立額	2,040,700
積み終了先	643,800	積数	637,200
超過準備	455,500	1日平均	21,200
非準預先残高	211,600	積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	2,040,700
準備預金進捗率	68.78% (実績)		3.23% (日数)

JGB新発10年債	0.295	0.005	日経平均株価(終値)	19,049.91	484.01	為替(9時)	121.66-67
						為替(5時)	121.91-93

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	12/9	12/10	12/11	12/14	12/15	12/16
日銀当預残	2,411,900	2,393,800	2,406,100	2,394,600	2,462,000	2,476,200
準備預金残	2,202,200	2,182,600	2,195,700	2,188,400	2,250,500	2,264,600
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07633%	0.07640%	0.07631%	0.07629%	0.07627%	0.07625%

12/16の加重平均レート(速報)				12/15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	無担先日付分	有担当日分		
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.030 ~0.130 (0.076)				T/N	0.073 ~0.130 (0.080)			
				S/N				
				1W	0.155 (0.155)	0.130 (0.130)		
				2W		0.098 ~0.165 (0.110)		
				3W				
0.170 ~0.200 (0.185)		0.07-0.12	-	1M		0.155 (0.155)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.025	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.09-▲0.0409	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

全店共通	15,000億円	12/18	~ 3/29 (102日間)	応札	2,350億円	落札	2,350億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	4,000億円	12/16	~ 12/17 (1日間)	応札	125億円	落札	125億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債補完	8,000億円	12/16	~ 12/17 (1日間)	応札	2億円	落札	2億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	3,500億円	12/18		応札	6,687億円	落札	3,503億円	按分利回り較差	0.002%	56.5%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	3,500億円	12/18		応札	10,737億円	落札	3,505億円	按分利回り較差	0.008%	47.7%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	12/18		応札	11,965億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	0.007%	86.3%	平均利回り較差	0.008%
T-BillY	応札10兆6,787億円			落札	2兆3,288億8,000万円 (非競争入札:1,711億円)			12/21~2016/12/20	▲0.0409%	按分84.6240%	平均▲0.0489%	

「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