

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,400	▲ 5,400	▲ 6,000
財政		▲ 700	4,000	1,000
資金過不足		▲ 5,100	▲ 1,400	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,100		
63,715		▲ 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			11,200	
CP等買入				
		▲ 700	▲ 1,300	
貸出支援基金				
(成長) 58,484				
(増加) 271,714				
被災地支援				0
3,161				0
社債等買入			1,300	
ETF買入		700		
国債補充供給	即日	▲ 500		
		100	500	
小計		500	11,700	0
当預増減		▲ 4,600	10,300	▲ 5,000

当座預金残高	2,527,300	12/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,304,400		55,800
積み終了先	1,844,200	12/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,841,000	積数	35,500
非準備預先残高	222,900	1日平均	1,500
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	98.26% (実績)		25.81% (日数)

12/21のマナタリーベース		3,541,800	
12/21コール合計	212,854	無担	66,929
		有担	145,925
コール前日増減	計	5,474	無担
		3,040	有担
			2,434

12/22の加重平均レート(速報)				12/21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	単位(%)	
0.030 ~0.125 (0.074)	0.030	~0.040 (0.031)				無担当日分	有担当日分
0.070 ~0.121 (0.079)						0.060 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)
						0.073 ~0.121 (0.081)	
0.148 ~0.160 (0.152)						0.117 (0.117)	
						0.117 ~0.165 (0.140)	
0.170 (0.170)				0.07-0.12	-	0.114 (0.114)	
				0.07-0.11	-		有担先日付分
				0.07-0.11	▲0.012-▲0.01		
				-	-		
				-	-		
				-	-		
				-	-		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 16,566億円 12/22 ~ 12/24 (2日間) 応札 470億円 落札 470億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 12/24 ~1/7 (14日間) 応札 7200万ドル 落札 7200万ドル 貸付利率0.830%
 2年利付国債(表面利率0.10%) 応札10兆9,882億円 落札2兆3,256億円(I非競争入札:1,738億円) 2016/1/15/~2018/1/15 ▲0.0090% 按分71.3256% 平均▲0.0130%

「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

<< 12/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,537,600	前日比	10,300
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。					

<< 22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1兆8,000億円減の184兆8,000億円(当座預金残高見込みは、252兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託から0.073~0.075%の調達希望。出合いの中心は0.074~0.075%となった。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。

<< 22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。短国市場は年末を控え、材料少なく、小動き閑散。CP市場は五・十日発行にあたり、まとまった発行が散見された。発行総額は5,300億円程度と償還総額2,700億円程度を大きく上回った。発行レートは、期内物は上昇基調となった一方、期越物は最上核銘柄を筆頭に低位で推移し、逆イールドが強まっていた。

<< 23日の材料 >>

- *天皇誕生日
- *米国11月の新築一戸建て販売件数 *米国11月の耐久財新規受注
- *米国11月の個人所得・消費支出 *英国7-9月期のGDP確報値

<< 24日の材料 >>

- *黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議員会にて講演
- *金融政策決定会合議事要旨(11月18,19日分)
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、12/28発行)
- *ユーロ圏祝日(Christmas Eve)

<< 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%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.20-22
0.270	0.000	18,886.70	▲ 29.32
		為替(5時)	121.11-12

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	12/15	12/16	12/17	12/18	12/21	12/22
日銀当預残	2,462,000	2,476,200	2,474,500	2,479,800	2,531,900	2,527,300
準備預金残	2,250,500	2,264,700	2,241,500	2,255,500	2,308,000	2,304,400
レート	0.076%	0.076%	0.089%	0.075%	0.075%	0.074%
月中平均	0.07627%	0.07625%	0.07700%	0.07670%	0.07662%	0.07639%