

<<資金需給>>

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想		16日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,800	▲ 2,200	▲ 3,000		
財政		▲ 9,500	58,700	3,000		
資金過不足		▲ 11,300	56,500	0		
貸出						
売出手形						
本店共通						
全店共通						
共通(固定)			8,200			
70,235			▲ 8,200			
国債買現						
CP買現						
国庫短期証買入			5,000			
国庫短期証売却						
国債買入			7,700	7,800		
CP等買入						
貸出支援基金					20,200	
(成長) 58,484						
(増加) 252,028					▲ 500	
被災地支援						
3,161						
社債等買入		▲ 100	▲ 400			
ETF買入		200	200			
国債補完供給						
小計		▲ 200	11,700	27,500		
当預増減		▲ 11,500	68,200	27,500		

<< 12/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,462,800	前日比	68,200
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。

<< 14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7,000億円減の180兆1,000億円(当座預金残高見込みは、239兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託の0.075~0.076%の調達希望で始まり、出合いの中心も0.075~0.076%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、目立った出合いは見られなかった。

<< 14日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は全般的に閑散な中、3Mが▲0.015%、6Mが▲0.095%の出合いが見られた程度であった。CP市場は機械、石油、不動産業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,300億円程度に達した。発行レートは、年越物に対するニーズが依然として強く、低位で決着する銘柄が多く見られた。

<< 15日の材料 >>
 *米国FOMC(1日目)
 *米国11月の消費者物価指数
 *英国11月の消費者物価指数
 *5年利付国債入札(25,000億円、12/21発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、12/24借入)

当座預金残高	2,394,600	12/14以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,188,400	12/15以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,796,400	積数	0
超過準備	1,796,400	1日平均	0
非準備先残高	206,200		
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	100.00% (実績)	96.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.295	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	18,883.42	▲ 347.06	為替(9時)	120.88-90
						為替(5時)	121.23-25

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	12/7	12/8	12/9	12/10	12/11	12/14
日銀当預残	2,393,300	2,405,500	2,411,900	2,393,800	2,406,100	2,394,600
準備預金残	2,173,100	2,188,500	2,202,200	2,182,600	2,195,700	2,188,400
レート	0.077%	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07643%	0.07638%	0.07633%	0.07640%	0.07631%	0.07629%

12/11のマナタリーベース		3,398,300	
12/11コール 合計	219,486	無担	78,709
有担	140,777		
コール前日増減 計	▲ 833	無担	1,835
有担	▲ 2,668		

12/14の加重平均レート(速報)				12/11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
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)					0.060 ~0.080 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.080)							0.073 ~0.121 (0.079)	
0.128 (0.128)								
0.114 ~0.340 (0.133)								
0.113 (0.113)								
				0.07-0.12	-			有担先日付分
				0.07-0.11	-			
				0.07-0.11	▲0.015			
				-	▲0.095			
				-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	4,000億円	12/16	応札	10,675億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.008%	47.9%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	2,400億円	12/16	応札	7,024億円	落札	2,409億円	按分利回り較差	-0.004%	93.6%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,400億円	12/16	応札	3,930億円	落札	1,406億円	按分利回り較差	-0.006%	55.2%	平均利回り較差	-0.004%
貸出増加支援	12/16~2016/12/15 (365日間)	貸付予定総額	189億円	貸付利率	0.10%						
貸出増加支援	12/16~2017/12/15 (730日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%						
貸出増加支援	12/16~2019/12/16 (1461日間)	貸付予定総額	19,976億円	貸付利率	0.10%						
ETF買入	369億円	約定日	12/14								

「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論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