

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,100	▲ 2,200	▲ 4,000
財政		57,800	1,700	3,000
資金過不足		55,700	▲ 500	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		8,200		
70,175		▲ 8,200		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		5,000		
国庫短期証売却				
国債買入		7,700	8,300	
CP等買入		▲ 800	▲ 500	
貸出支援基金			20,200	
(成長) 58,484				
(増加) 252,028			▲ 11,200	
被災地支援				
3,161				
社債等買入		▲ 400		
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		11,700	16,800	0
当預増減		67,400	16,300	▲ 1,000

<< 12/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,478,300	前日比	16,300
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。

<< 15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4兆5,000億円増の184兆6,000億円(当座預金残高見込みは、246兆3,000億円)。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。

<< 15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、6M▲0.095%、3M▲0.024%の出合いが見られた程度であった。C P市場は自動車、ノンバンク業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,200億円程度に達した。発行レートは年内物、年越物共に低位で推移した。C P等買入オペは、5,500億円度オファーされた。500億円の増額となったことや、応札可能な銘柄が限定的であったこともあり、平均レート0.056%、按分レート0.047%と前回オペ比で小幅低下した。

- << 16日の材料 >>
- *米国FOMC(2日目)
 - *米国FRB経済見通し発表
 - *米国11月の住宅着工件数
 - *米国11月の鉱工業生産・設備稼働率
 - *ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値
 - *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、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	2,462,000	12/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,250,500	12/16以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,844,100	積数	2,040,700
超過準備	1,844,100	1日平均	65,800
非準備先残高	211,500	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,969,500

12月の新所要見込 **65,800** (一日平均)

12/14のマナタリーベース		3,388,600	
12/14コール	合計	213,195無担	71,264有担
141,931			
コール前日増減	計	▲ 6,291無担	▲ 7,445有担
1,154			

JGB新発10年債	0.290	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,565.90	▲ 317.52	為替(9時)	121.11-14
						為替(5時)	120.61-62

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	12/8	12/9	12/10	12/11	12/14	12/15
日銀当預残	2,405,500	2,411,900	2,393,800	2,406,100	2,394,600	2,462,000
準備預金残	2,188,500	2,202,200	2,182,600	2,195,700	2,188,400	2,250,500
レート	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07638%	0.07633%	0.07640%	0.07631%	0.07629%	0.07627%

12/15の加重平均レート(速報)				12/14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)			0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.130 (0.080)					0.073 ~0.121 (0.080)			
					1W	0.128 (0.128)		
0.130 ~0.155 (0.143)					2W	0.114 ~0.340 (0.133)		
0.098 ~0.165 (0.110)					3W	0.113 (0.113)		
		0.07-0.12	-		1M		有担先日付分	
0.155 (0.155)		0.07-0.11	-		2M			
		0.07-0.11	▲0.024		3M			
		-	▲0.095		6M			
		-	-		1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 5,500億円 12/18 応札 10,888億円 落札 5,480億円 按分レート 0.047% 91.0% 平均落札レート 0.056%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 12/17~12/24(7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.820%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札9兆6,960億円 落札2兆2,806億円(I非競争入札:2,183億円) 12/21~2020/12/20 0.037% 按分31.0392% 平均0.035%
 交付税特会 1兆500億円 12/24~2016/6/24 応札 3兆1,400億円 落札 1兆500億円 0.105% 按分 38.0000% 平均 0.097%

「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