

<<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想		24日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 3,300	▲ 4,200	▲ 5,000		
財政		57,200	▲ 1,600	4,000		
資金過不足		53,900	▲ 5,800	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		800	1,100			
62,845		▲ 1,300	▲ 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					10,800	
CP等買入		▲ 1,100	▲ 700			
貸出支援基金(成長)						
58,484(増加) 271,714						
被災地支援						
3,161						
社債等買入		▲ 100			1,300	
ETF買入				700		
国債補完供給	即日	▲ 100	100			
小計		▲ 1,800	1,000	12,100		
当増減		52,100	▲ 4,800	11,100		

当座預金残高	2,531,900	12/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,308,000		73,700
積み終了先	1,838,800	12/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,835,600	積数	55,800
非準備先残高	223,900	1日平均	2,200
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	97.27%	(実績)	19.35% (日数)

12/18のマナタリーベース		3,486,400	
12/18コール合計	207,380	無担	63,889
		有担	143,491
コール前日増減	計	▲ 19,840	無担 ▲ 20,267
			有担 427

12/21の加重平均レート(速報)				12/18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 ~0.130 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.081)						T/N		0.070 ~0.130 (0.084)	
						S/N			
						1W	0.117 (0.117)	0.130 (0.130)	
						2W			
0.117 ~0.165 (0.140)						3W		0.114 (0.114)	
0.114 (0.114)						1M			有担先日付分
				0.07-0.12	-	2M			
				0.07-0.11	-	3M			
				0.07-0.11	-	6M			
				-	▲0.095	1Y			
				-	▲0.092-▲0.09				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	19,404億円	12/21	~ 12/22 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債補完	4,000億円	12/21	~ 12/22 (1日間) 応札	59億円	落札 59億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	3,500億円	12/24	応札 9,952億円	落札 3,500億円	按分利回り較差	0.013%	97.7%	平均利回り較差 0.014%
国債買入	3,500億円	12/24	応札 11,878億円	落札 3,502億円	按分利回り較差	0.001%	18.9%	平均利回り較差 0.004%
国債買入	2,400億円	12/24	応札 7,419億円	落札 2,405億円	按分利回り較差	-0.008%	42.6%	平均利回り較差 -0.004%
国債買入	1,400億円	12/24	応札 4,738億円	落札 1,401億円	按分利回り較差	-0.022%	64.2%	平均利回り較差 -0.019%
ETF買入	369億円	約定日	12/21					

「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

<< 12/22の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,527,100	前日比	▲ 4,800
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。					

<< 21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1兆円増の186兆6,000億円(当座預金残高見込みは253兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託の0.073~0.075%、大手行からは0.072~0.075%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、大手行が年内エンドの1W物を0.117%で調達した。

<< 21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。短国市場は引け際に6M物で▲0.095%、1Y物で▲0.092~▲0.09%が出合いが見られた程度で、閑散だった。CP市場は建築、不動産業等の複数業態からまとまった発行が見られ、発行額は3,600億円を上回った。発行レートは、最上格銘柄でゼロ%近辺の出合いが見られたものの、全体としては横ばい圏での推移となっていた。

<< 22日の材料 >>
*米国7-9月期のGDP確報値
*米国11月の中古住宅販売
*2年利付国債入札(25,000億円、2016/1/15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%

JGB新発10年債	0.270	0.005	日経平均株価(終値)	18,916.02	▲ 70.78	為替(9時)	121.27-30
						為替(5時)	121.28-30

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	12/14	12/15	12/16	12/17	12/18	12/21
日銀当座預金	2,394,600	2,462,000	2,476,200	2,474,500	2,479,800	2,531,900
準備預金残	2,188,400	2,250,500	2,264,700	2,241,500	2,255,500	2,308,000
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.089%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07629%	0.07627%	0.07625%	0.07700%	0.07670%	0.07662%