

◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	5日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	▲ 1,700	▲ 2,000
財政		▲ 36,000	2,900	5,000
資金過不足		▲ 37,000	1,200	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
80,577				
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		10,200		8,000
CP等買入				
		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金				15,700
(成長) 38,608				
(増加) 159,053				▲ 9,800
被災地支援				
3,246				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		10,100	0	13,900
当増減		▲ 26,900	1,200	16,900

当座預金残高	1,658,300	12/3以降の残り所要積立額	18,800
準備預金残高	1,518,000	12/4以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,280,000	積数	15,800
超過準備	1,279,800	1日平均	1,300
非準備先残高	140,300	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,874,400
準備預金進捗率	99.16% (実績)		60.00% (日数)

12/2のマネタリベース		2,610,400	
12/2コール 合計	200,651	無担	81,432
コール前日増減	▲ 519	無担	▲ 602
		有担	83

12/3の加重平均レート(速報)		12/2の加重平均レート(確報)		単位 (%)
無担(平均)	有担(平均)	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.030 ~0.080 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)	O/N 0.055 ~0.075 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.063 ~0.125 (0.069)		T/N	0.063 ~0.120 (0.067)	
		S/N		
		1W	0.087 ~0.180 (0.103)	
		2W	0.160 (0.160)	0.310 (0.310)
		3W		0.118 (0.118)
0.134 (0.134)		1M	0.118 (0.118)	有担先日付分
		2M		
		3M		
		6M		
		1Y		

◀ オペ情報、入札結果 ▶

国債買入	4,000億円	12/5	応札	9,457億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	0.001%	41.2%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,400億円	12/5	応札	6,593億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	0.001%	90.3%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	1,600億円	12/5	応札	4,652億円	落札	1,605億円	按分利回り較差	0.001%	23.9%	平均利回り較差	0.004%
交付税特会	1兆500億円	12/11~2015/6/11	応札	3兆2,485億円	落札	1兆500億100万円	0.090%	按分	55.6140%	平均	0.088%

◀ 12/4の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,659,500	前日比	1,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%での出合いが中心になると見込まれる。

◀ 3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2兆1,000億円減の128兆3,000億円(当座預金残高見込みは165兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統業態から0.063~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。税揚げ要因から大幅な不足日となったものの、地合いに大きな変化は見られず、終日落ち着いた取引となった。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた程度。

◀ 3日のオープン市場動向 ▶  
 現先取引S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は終日閑散な地合いであった。CP発行市場は鉄鋼・電機・通信業態からまとまった額の発行が複数見られ、発行総額は3,700億円程度に膨らんだ。発行レートは、年内償還物を中心に上昇していた。

- ◀ 4日の材料 ▶
- \*佐藤日銀審議委員、高知県金融経済懇談会にて講演
  - \*ECB定例理事会(金融政策発表あり)
  - \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、12/8発行)
  - \*流動性供給入札(3,000億円、12/8発行)

◀ コール11月の加重平均レート ▶			
(土日を含む)	無担	0.06483%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06489%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.430	0.005	日経平均株価(終値)	17,720.43	57.21	為替(9時)	119.18-20
						為替(5時)	119.22-23

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	11/26	11/27	11/28	12/1	12/2	12/3
日銀当預残	1,688,300	1,698,200	1,702,800	1,692,900	1,685,200	1,658,300
準備預金残	1,543,600	1,550,600	1,561,100	1,549,700	1,546,500	1,518,000
レート	0.066%	0.066%	0.067%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06454%	0.06459%	0.06483%	0.06500%	0.06500%	0.06500%

「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