

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想		8日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 1,800	▲ 1,000		
財政		3,200	9,100	▲ 16,000		
資金過不足		1,500	7,300	▲ 17,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,400	
80,577					▲ 1,700	
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			8,600			
CP等買入						
		▲ 100	▲ 400			
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				
国債補充供給						
小計		0	14,100	▲ 300		
当預増減		1,500	21,400	▲ 17,300		

当座預金残高	1,659,800	12/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,513,200		15,800
積み終了先	1,275,200	12/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,275,100	積数	12,800
非準備預金残高	146,600	1日平均	1,200
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	99.32%	(実績)	63.33% (日数)

12/3のマネタリーベース		2,584,500	
12/3コール	合計	204,521	無担 83,665 有担 120,856
コール前日増減	計	3,870	無担 2,233 有担 1,637

12/4の加重平均レート(速報)			12/3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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.030 ~0.080 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.063 ~0.120 (0.070)				0.063 ~0.125 (0.069)		
0.115 (0.115)						
0.080 ~0.152 (0.121)		0.08-0.12		0.078 ~0.134 (0.080)	有担先日付分	
		0.08-0.12				
		0.08-0.12	▲0.005~0.00			
		-				
		-				
		-				

12/5の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,681,200	前日比	21,400
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<< 4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3,000億円増の128兆6,000億円(当座預金残高見込みは166兆円)。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。一巡後は、0.06~0.063%で散発的に出合うなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは横ばい圏での推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引はこう着状態のなか特段出合いが見られず、落札結果は平均利回り▲0.0044%按分利回り±0%となった。セカンダリーでは落札水準近辺の▲0.005~▲0.003%の出合いが確認される程度にとどまった。CP発行市場は鉄鋼・機械業態より大型案件があり、発行総額は1,700億円程度となった。一般的にレート上昇傾向が続いている。CP等買入オベが4,500億円程度で実施され、各利回りは平均0.085%按分0.082%と前回(0.082%・0.071%)から上昇した。

<< 5日の材料 >>
 *10月の景気動向指数速報 *11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国10月の貿易収支 *米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫
 *米国10月の消費者信用残高 *米国11月の雇用統計
 *ユーロ圏7-9月期のGDP改定値
 *預金保険機構借入(12ヶ月程度、12/12借入)

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	0.435	0.005	日経平均株価(終値)	17,887.21	166.78	為替(9時)	119.86-88
						為替(5時)	119.88-90

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	11/27	11/28	12/1	12/2	12/3	12/4
日銀当預残	1,698,200	1,702,800	1,692,900	1,685,200	1,658,300	1,659,800
準備預金残	1,550,600	1,561,100	1,549,700	1,546,500	1,518,000	1,513,200
レート	0.066%	0.067%	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06459%	0.06483%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06500%

<< オペ情報、入札結果 >>
 全店共通 8,000億円 12/8 ~ 3/9 (91日間) 応札 1,350億円 落札 1,350億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 4,500億円 12/9 応札 10,879億円 落札 4,480億円 按分レート 0.082% 56.2% 平均落札レート 0.085%
 T-Bill3M 応札45兆1,662億円 落札5兆2,368億7,000万円(非競争入札:4,430億円) 12/8~2015/3/16 0.0000% 按分2.2765% 平均▲0.0044%
 流動性供給 応札 8,717億円 落札 3,000億円 12/8 募入最大利回較差 0.019% 按分 60.0000% 募入平均利回較差 0.012%
 J-REIT買入 13億円 約定日 12/4

「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す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