

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		8日需給予想		9日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,800	300	▲ 2,000		
財政		9,000	▲ 16,600	0		
資金過不足		7,200	▲ 16,300	▲ 2,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			1,400	5,700		
80,577			▲ 1,700	▲ 6,100		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				7,500		
国庫短期証売却						
国債買入		8,600		8,000		
CP等買入				4,500		
貸出支援基金		▲ 400	▲ 300			
(成長) 44,583		15,700				
(増加) 159,053		▲ 9,800				
被災地支援						
3,246						
社債等買入			▲ 200			
ETF買入						
国債補完供給	即日	▲ 100	100			
小計		14,000	▲ 700	19,600		
当増減		21,200	▲ 17,000	17,600		

当座預金残高	1,681,000	12/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,536,700		12,800
積み終了先	1,300,100	12/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,299,400	積数	7,400
非準備先残高	144,300	1日平均	900
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,887,600
準備預金進捗率	99.61%	(実績)	73.33% (日数)

12/4のマナターベース		2,587,600	
12/4コール	合計	204,345	無担 83,065 有担 121,280
コール前日増減	計	▲ 176	無担 ▲ 600 有担 424

12/5の加重平均レート(速報)				12/4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
0.030 ~0.080 (0.067)	0.030	~0.040 (0.031)				0.050 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.066 ~0.120 (0.081)							0.063 ~0.120 (0.070)		
0.116 ~0.125 (0.121)									
0.160 ~0.310 (0.179)							0.115 (0.115)		
0.118 (0.118)									
0.078 ~0.118 (0.082)				0.08-0.12	-			0.080 ~0.152 (0.121)	有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	▲0.010~0.00				
				-	▲0.010				
				-	-				
				-	-				

<< 12/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,664,000	前日比	▲ 17,000
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%の出合いが中心になると見込まれる。

<< 5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1兆3,000億円増の129兆9,000億円(当座預金残高見込みは168兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統業態から0.066~0.068%、大手行からは0.065~0.067%での調達で始まった。一巡後もビッド水準は底堅く、0.06%台後半で散発的に出合いが見られつつ、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。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは横ばいからやや低下で推移した。短国市場は前回実施分から2,500億円減額の7,500億円で短国買入オペが実施された。今後の買入ペースに不透明感が漂うなか、各利回り較差は平均+0.011%、按分+0.001%とやや軟調な結果となった。オペ後は3M物で▲0.01%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は案件が少なく、発行総額は800億円弱であった。発行レートは全般的に若干上昇した。

<< 8日の材料 >>
 *7-9月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率▲0.5%)
 *10月の国際収支 *11月の景気ウォッチャー調査
 *米国11月のFRB労働市場情勢指数
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、12/10発行)

JGB新発10年債	0.420	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	17,920.45	33.24	為替(9時)	119.79-81
						為替(5時)	120.17-18

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	11/28	12/1	12/2	12/3	12/4	12/5
日銀当預残	1,702,800	1,692,900	1,685,200	1,658,300	1,659,800	1,681,000
準備預金残	1,561,100	1,549,700	1,546,500	1,518,000	1,514,700	1,536,700
レート	0.067%	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.067%
月中平均	0.06483%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06586%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	10,000億円	12/9	~ 3/20 (101日間)	応札	5,655億円	落札	5,655億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	2,000億円	12/5	~ 12/8 (3日間)	応札	43億円	落札	43億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	7,500億円	12/9		応札	16,946億円	落札	7,502億円	按分利回り較差	0.001%	26.6%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	4,000億円	12/9		応札	11,220億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.007%	79.0%	平均利回り較差	-0.006%
国債買入	2,400億円	12/9		応札	5,554億円	落札	2,403億円	按分利回り較差	-0.019%	35.2%	平均利回り較差	-0.012%
国債買入	1,600億円	12/9		応札	6,052億円	落札	1,605億円	按分利回り較差	-0.020%	52.0%	平均利回り較差	-0.016%
預保借入(金融機能強化勘定)	170億円	12/12	~2015/11/27	応札	1,160億円	落札	170億円	0.090%	按分	11.765%	平均	0.089%
ETF買入	374億円	約定日	12/5									

「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